

MULTI UNITS LUXEMBOURG
Société d'investissement à capital variable
Luxembourg

Prospectus

Mars 2024

Le présent prospectus (le « **Prospectus** ») n'est valide que s'il est accompagné de la version la plus récente du rapport annuel et, s'il est paru postérieurement au rapport annuel, du rapport semestriel non audité. Ces rapports font partie intégrante du présent Prospectus.

Outre le présent Prospectus, la Société a également adopté un DIC par Catégorie d'actions qui récapitule les principales informations relatives à chaque Catégorie d'actions. Le DIC est disponible gratuitement au siège social de la Société et du Dépositaire.

MULTI UNITS LUXEMBOURG*Société d'investissement à capital variable*

Siège social :

9, rue de Bitbourg, L-1273 Luxembourg

R.C.S. Luxembourg B 115 129

OFFRE D'ACTIONS

Ce document est une offre de souscrire à des actions (les « **Actions** ») sans valeur faciale de MULTI UNITS LUXEMBOURG (la « **Société** »), chaque Action étant liée à un compartiment de la Société (le ou les « **Compartiment(s)** ») tels qu'ils sont décrits ci-dessous.

Les Actions de chacun des Compartiments peuvent être divisées en catégories (les « **Catégories** » ou « **Classes** »).

Pour tous renseignements supplémentaires sur les droits attachés aux diverses Catégories d'actions, voir le paragraphe « Catégories d'actions ».

INFORMATIONS IMPORTANTES

En cas de doute quant au contenu de ce Prospectus, veuillez consulter votre courtier, conseiller fiscal, expert-comptable ou autre conseiller financier. Nul n'est autorisé à donner de quelconques informations autres que celles qui figurent dans le présent Prospectus et dans le DIC relatif à chaque Compartiment, ou dans l'un quelconque des documents auxquels il est fait référence dans les présentes et qui peuvent être examinés par le public au 9, rue de Bitbourg, L-1273 Luxembourg.

- La Société est enregistrée au Grand-Duché du Luxembourg en tant qu'organisme de placement collectif en valeurs mobilières (un « **OPCVM** ») sous la forme de société d'investissement à capital variable (« **SICAV** »). Cependant, le fait qu'elle soit enregistrée n'implique pas que l'autorité de surveillance porte un jugement positif sur le contenu de ce Prospectus ou de tout DIC, non plus que sur la qualité des Actions proposées à la vente. Toute déclaration contraire n'est pas autorisée et est illégale.
- Le présent Prospectus et/ou d'une façon générale, toute information ou tout document relatif à la Société et/ou aux Compartiments ou en lien avec ces derniers, ne constituent pas une offre ou une sollicitation par quiconque, dans toute juridiction où une telle offre ou sollicitation n'est pas autorisée, ou à toute personne à qui il est interdit d'effectuer une telle offre ou sollicitation.
- Toute information donnée par toute personne qui n'est pas mentionnée dans ce Prospectus doit être considérée comme non autorisée. Le Conseil d'administration a pris les précautions nécessaires pour s'assurer que les informations figurant dans ce

Prospectus sont exactes à la date de publication et en assume la responsabilité en conséquence. Ce Prospectus peut être mis à jour de temps à autre afin de rendre compte de changements importants et les souscripteurs éventuels doivent demander à la Société si un Prospectus ou DIC plus récent est paru.

- La circulation et la distribution du présent Prospectus, qui pourra être modifié et reformulé de temps à autre, les DIC, ainsi que l'offre des Actions peuvent être restreintes dans certaines juridictions. Les personnes recevant ce Prospectus et/ou d'une façon générale, toute information ou tout document relatif ou lié à la Société et/ou aux Compartiments sont priées de s'informer desdites restrictions et de les respecter. L'offre, la vente ou l'achat d'Actions, ou la distribution, la circulation ou la possession du Prospectus et/ou de toute information ou de tous documents relatifs à la Société et/ou aux Compartiments, ou en lien avec ces derniers, doivent être conformes aux lois et aux réglementations applicables en vigueur dans toute juridiction où l'offre, la vente ou l'achat d'Actions a lieu, ou dans laquelle se produit la distribution, la circulation ou la possession du Prospectus et/ou de toute information ou tout document relatifs à la Société et/ou aux Compartiments ou en lien avec ces derniers. Il convient notamment d'être conforme concernant l'obtention du consentement, de l'approbation ou de l'autorisation exigée par ces lois et réglementations, le respect de toute autre formalité d'usage et le paiement de tous frais d'émission, de transfert ou d'autres taxes dus dans cette juridiction. Il est de la responsabilité de toute personne en possession de ce Prospectus et des DIC ainsi que de toute personne souhaitant souscrire des Actions conformément à ce Prospectus et aux DIC de s'informer de tous les règlements et lois en vigueur dans tout État concerné et de les respecter. Elle devra notamment obtenir toutes les autorisations officielles ou les autres agréments qui pourraient être requis, remplir toutes les formalités d'usage et payer tous frais d'émission, de transfert ou d'autres taxes exigées dans cet État. Les souscripteurs ou acheteurs d'Actions éventuels doivent s'informer des conséquences fiscales éventuelles, des règles légales et de toutes restrictions sur les changes ou exigences résultant d'un contrôle des changes auxquelles ils pourraient être soumis en vertu de la législation du pays dont ils sont les ressortissants ou dans lequel ils ont leur résidence ou domicile et qui pourraient être pertinentes pour la souscription, l'achat, la

détention, la conversion ou la vente d'Actions.

INVESTISSEURS VISÉS

Le profil de l'investisseur type est, pour chaque Compartiment, décrit dans chaque Annexe jointe au présent Prospectus et dans chacun des DIC.

Les Ressortissants américains (« U.S. Persons », définis ci-après) ne peuvent pas investir dans les Compartiments.

HISTORIQUE DE PERFORMANCES

L'historique des performances de chaque Catégorie d'actions sera présenté dans la section « Performances passées » pertinente de www.amundiETF.com si les performances passées d'une année civile complète sont disponibles après le lancement de la Catégorie d'actions concernée.

RESTRICTIONS EN MATIÈRE DE VENTE ET DE DISTRIBUTION

À la date du présent Prospectus, la Société est autorisée à proposer les Actions au Luxembourg. La distribution des actions de la Société ou de Compartiments spécifiques peut aussi être autorisée ultérieurement dans d'autres États. La liste des pays où les Compartiments sont autorisés à la distribution en tout ou partie peut être obtenue au siège de la Société.

Ce Prospectus ne peut être distribué dans le but d'offrir ou de commercialiser les Actions dans un quelconque État ou dans toutes circonstances dans lesquels leur offre ou leur commercialisation n'est pas autorisée ou est illégale.

Aucune personne recevant un exemplaire de ce Prospectus et des DIC dans un quelconque État ne doit considérer ce Prospectus et lesdits DIC comme une invitation à souscrire des Actions, sauf si une telle invitation peut être faite légalement dans cet État sans se conformer à une quelconque obligation d'enregistrement ou autre exigence légale.

Aucune personne n'a été autorisée à fournir des informations ou à émettre des déclarations concernant l'émission d'Actions autres que celles qui sont contenues dans le présent Prospectus, à l'égard de l'offre d'Actions et, si une telle information est fournie ou une telle déclaration est faite, elle ne doit pas être considérée comme ayant été autorisée par la Société. Vous devez vous assurer que le Prospectus que vous avez reçu n'a pas été modifié, amendé ou reformulé dans d'autres versions ultérieures. Cependant, la livraison du présent Prospectus et l'émission des Actions ne doivent, en aucune circonstance, donner lieu à la conclusion qu'il n'y a eu aucun changement dans les affaires de la Société depuis la date des présentes.

Les Actions n'ont pas été et ne seront pas enregistrées en vertu du Securities Act of 1933 des États-Unis (tel qu'amendé) (la « **Loi de 1933** »), ni de la législation en matière de valeurs mobilières de l'un quelconque des États faisant partie des États-Unis. Les Actions ne peuvent être offertes, vendues ou livrées, directement ou indirectement, aux États-Unis, dans ses territoires ou ses possessions, ou dans le District de Columbia (les « **États-Unis** ») non plus que pour le compte ou au profit d'un Ressortissant américain (ou « US Person »), tel que défini ci-après. Aucune commission américaine sur les valeurs mobilières, au niveau national ou régional, n'a vérifié ni approuvé le présent Prospectus. Toute déclaration contraire est passible de sanctions pénales. Toute offre réitérée ou revente de quelconques Actions à un « Ressortissant américain » (« U.S. Person ») ou dans le territoire des États-Unis peut constituer une violation de la législation des États-Unis.

Les Actions ne seront offertes qu'en dehors des États-Unis en vertu de la Règlementation S de la Loi de 1933. Les détenteurs d'Actions ne seront pas autorisés à vendre, transférer ou céder directement ou indirectement (par exemple par voie de contrat de swap ou d'un autre contrat de dérivé, d'une prise de participation ou d'autres contrat ou accord similaires) leurs Actions à un Ressortissant américain. Toute vente, transfert ou cession sera nul.

La Société ne se fera pas enregistrer selon le United States Investment Company Act de 1940 (tel qu'amendé) (la « **Loi sur les sociétés de placement** »). Selon les interprétations de la Loi sur les sociétés de placement par les membres de la Securities and Exchange Commission des États-Unis en ce qui concerne les sociétés de placement étrangères, si un Compartiment restreint ses bénéficiaires effectifs qui sont des Ressortissants américains et n'offre ou ne propose pas de valeurs mobilières au public, il ne sera pas soumis à la procédure d'enregistrement prévue par la Loi sur les sociétés de placement. Pour veiller au respect de cette exigence, les Administrateurs peuvent demander le rachat obligatoire des Actions dont les bénéficiaires effectifs sont des Ressortissants américains.

Toute personne souhaitant acquérir des Actions sera tenue de déclarer qu'elle n'est pas un « Ressortissant américain » (« U.S. Person »). Tous les Actionnaires sont tenus de notifier la Société de tout changement de leur situation en tant que personne qui n'est pas un Ressortissant américain (non-U.S. Person).

« **Ressortissant américain** » (« U.S. Person ») s'entend comme **(A)** un « Ressortissant américain » au sens du Règlement S pris en application du U.S. Securities Act de 1933, tel qu'amendé ; ou **(B)** toute personne autre qu'une « personne qui n'est pas un Ressortissant américain » définie au titre de la Règle CFTC 4.7(a)(1)(iv) ; **(C)** un « Ressortissant américain » au sens de la Section 7701 (a)(30) du code fiscal américain (Internal Revenue Code) de 1986, tel qu'amendé.

PORTÉE DU PRÉSENT PROSPECTUS ET DES DIC

Les Actions de tout Compartiment décrit dans le présent Prospectus ainsi que dans les DIC pertinents ne sont proposées que sur la base des informations qui y figurent et (le cas échéant) de tout addendum au Prospectus et aux DIC, ainsi que de la version la plus récente du rapport annuel audité et de tout rapport semestriel de la Société qui est paru par la suite.

Il ne doit être tenu compte d'aucune information ou déclaration supplémentaire qui serait donnée ou faite par tout distributeur, intermédiaire (« **Intermédiaire** », ce terme étant défini comme tout agent commercial, agent payeu et/ou mandataire ou distributeur nommé en vue d'offrir et vendre les Actions aux investisseurs et de traiter les demandes de souscription, de rachat, de conversion ou de transfert émanant des Actionnaires), contrepartiste, courtier en valeurs mobilières ou autre personne et, en conséquence, il ne faut pas y ajouter foi. Nul n'est autorisé à donner de quelconques informations ou faire de quelconques déclarations à propos de l'offre des Actions en dehors de celles qui sont contenues dans le présent Prospectus et (le cas échéant) dans tout addendum au Prospectus ainsi que dans tout rapport annuel ou semestriel qui leur serait postérieur et, si de telles informations ou déclarations sont données ou faites, elles ne doivent pas être considérées comme ayant été autorisées par le Conseil d'administration, la Société de gestion, le Dépositaire, l'Agent comptable des registres et Agent des transferts ou l'Agent administratif. Les déclarations figurant dans le présent Prospectus et les DIC reposent sur la législation et les pratiques en vigueur au Luxembourg à la date des présentes et sont sujettes à modification. Ni la remise du présent Prospectus ou des DIC, ni l'émission d'Actions n'auront, en quelques circonstances que ce soit, valeur de déclaration explicite ou implicite selon laquelle les affaires de la Société n'ont pas changé depuis la date des présentes.

Le présent Prospectus, le(s) DIC se rapportant au ou aux Compartiment(s) au(x)quel(s) souscrit un investisseur, les rapports annuel et semestriels et les Statuts de la Société peuvent être obtenus gratuitement au siège de la Société ou du Dépositaire sur demande.

RISQUES ASSOCIÉS AUX INVESTISSEMENTS

Tout investissement dans un Compartiment comporte un risque financier plus ou moins grand et qui varie d'un Compartiment à l'autre. La valeur des Actions et les gains qu'elles engendrent sont tout autant susceptibles de diminuer que d'augmenter et les investisseurs ne sont pas assurés de récupérer leur mise de fonds initiale.

La Société ne représente pas une obligation de et n'est pas garantie par la Société de gestion ou une quelconque filiale ou société affiliée d'Amundi Asset Management.

POLITIQUE EN MATIÈRE DE MARKET TIMING

La Société, si elle en a connaissance, n'autorise pas les pratiques associées au market timing (opportuniste de marché), parce qu'elles peuvent léser les intérêts de tous les Actionnaires.

Selon la Circulaire 04/146 de la CSSF, le market timing doit être compris comme une méthode d'arbitrage par laquelle, de façon systématique, un investisseur souscrit et convertit des unités, parts ou actions d'un même organisme de placement collectif (« OPC ») ou en demande le rachat en un bref laps de temps de manière à tirer profit d'écart temporels et/ou d'imperfections ou déficiences de la méthode de calcul de la valeur liquidative de cet OPC.

Les adeptes du market timing peuvent avoir l'occasion de se livrer à ces pratiques si la valeur liquidative (telle que définie ci-après) d'un OPC est calculée sur la base de prix du marché qui ne sont plus à jour (prix périmés) ou si cet OPC est déjà en train de calculer la valeur liquidative alors qu'il est encore possible de passer des ordres.

Les pratiques de market timing sont inadmissibles, parce qu'elles affectent les performances de l'OPC en alourdissant ses coûts et/ou en diluant ses bénéfices.

En conséquence, le Conseil d'administration, toutes les fois qu'il le juge approprié et à sa seule discrétion, peut ordonner respectivement à l'Agent comptable des registres et Agent des transferts et à l'Agent administratif d'appliquer l'une quelconque des mesures suivantes :

- ordonner à l'Agent comptable des registres et Agent des transferts de rejeter toute demande de conversion et/ou souscription d'Actions provenant d'investisseurs considérés comme pratiquant le market timing.

- l'Agent comptable des registres et Agent des transferts peut combiner les Actions appartenant à ou contrôlées par plusieurs titulaires afin d'apprécier si une ou plusieurs personnes se livrent à des pratiques de market timing.

- Si, pendant des phases de volatilité des marchés, un Compartiment est investi principalement dans des marchés qui sont fermés au moment où il est évalué, faire en sorte que l'Agent administratif permette que la Valeur liquidative par action soit ajustée de manière à rendre compte avec plus d'exactitude de la juste valeur des investissements de ce Compartiment à la date de son évaluation.

PROTECTION DES DONNÉES

Conformément aux dispositions de la loi du 1er août 2018 portant organisation de la Commission nationale pour la protection des données et du régime général sur la protection des données et de toute autre législation en matière de protection des données applicable au Luxembourg, ainsi qu'au Règlement 2016/679 du 27 avril 2016 relatif à la protection des personnes physiques à l'égard du traitement des données à caractère personnel et à la libre circulation de ces données (la « **Loi sur la protection des données** »), la Société, en tant que responsable du traitement des données (le « **Responsable du traitement** »), recueille, conserve et/ou traite, par voie électronique ou autre, les données à caractère personnel fournies par les investisseurs au moment de la souscription et/ou par les investisseurs potentiels afin de fournir les services requis par ces derniers et de respecter ses obligations légales.

Les données à caractère personnel traitées comprennent le nom, les coordonnées (y compris l'adresse postale et/ou l'adresse électronique), les coordonnées bancaires et le montant investi par chaque investisseur (et, si l'investisseur est une personne morale, les informations correspondantes de sa(ses) personne(s) de contact et/ou du(des) bénéficiaire(s) économique(s)) (les « **Données à caractère personnel** »).

L'investisseur peut, à sa discrétion, refuser de communiquer les Données à caractère personnel au Responsable du traitement des données. Dans ce cas, néanmoins, le Responsable du traitement des données peut refuser la souscription de l'investisseur dans la Société.

Les Données à caractère personnel sont traitées afin d'intégrer l'investisseur dans la Société, d'exécuter les contrats passés avec la Société, de gérer les intérêts de l'investisseur, de protéger les intérêts légitimes de la Société et de satisfaire aux obligations légales qui lui incombent. Ces données peuvent notamment être traitées aux fins suivantes : (i) administration des comptes et des commissions de distribution, souscriptions et rachats ; (ii) tenue du registre des actionnaires ; (iii) identification anti-blanchiment ; (iv) identification fiscale dans le cadre des obligations de la Directive 2003/48/CE de l'Union européenne en matière de fiscalité des revenus de l'épargne et de la CRS/FATCA ; (v) fournir des services afférents aux clients ; et (vi) marketing.

Les « intérêts légitimes » susmentionnés sont :

- Les finalités de traitement décrites aux points (v) et (vi) du paragraphe ci-dessus ;
- le respect des exigences en matière de responsabilité et des

obligations réglementaires de la Société au niveau mondial ; et

- l'exercice de son partenariat conformément à des normes de marché raisonnables.

Les Données à caractère personnel peuvent également être collectées, enregistrées, conservées, adaptées, transférées ou traitées et utilisées par les destinataires des données de la Société (les « **Destinataires** ») lesquels, dans le cadre des finalités mentionnées ci-dessus, font référence à l'Agent comptable des registres et Agent des transferts, la Société de gestion, les distributeurs, d'autres sociétés appartenant à Amundi Asset Management et ses sociétés affiliées, ainsi que les conseillers juridiques et les réviseurs d'entreprises de la Société. Ces informations ne seront transmises à aucun tiers non autorisé.

Les Destinataires peuvent communiquer les Données à caractère personnel à leurs agents et/ou délégués (les « **Destinataires secondaires** »), lesquels traitent ces données à la seule fin d'aider les Destinataires à fournir leurs services au Responsable du traitement et/ou à exécuter leurs propres obligations légales. Le Destinataire reste pleinement responsable de l'exécution des obligations du Sous-destinataire envers la Société.

Les Destinataires et Destinataires secondaires peuvent être situés à l'intérieur ou à l'extérieur de l'Union européenne (l'« **UE** »). Si les Destinataires et les Sous-destinataires se trouvent en dehors de l'UE, dans un pays n'assurant pas un niveau de protection adéquat des Données à caractère personnel et ne bénéficiant pas d'une décision d'adéquation adoptée par la Commission européenne, ce transfert devra faire l'objet d'accords légalement contraignants avec les Destinataires et/ou Sous-destinataires sous la forme des clauses types approuvées de la Commission européenne. À cet égard, l'investisseur est en droit de demander des copies du document pertinent autorisant le(s) transfert(s) des Données à caractère personnel vers ces pays en s'adressant par écrit au Responsable du traitement.

Les Destinataires et Destinataires secondaires peuvent, selon le cas, traiter les Données à caractère personnel en tant que sous-traitants (lorsque les Données à caractère personnel sont traitées sur instruction du Responsable du traitement), ou en tant que responsables du traitement des données distincts (lorsqu'ils traitent les Données à caractère personnel à des fins propres, à savoir l'exécution de leurs propres obligations légales). Les Données à caractère personnel peuvent également être transférées à des tiers tels que des organismes gouvernementaux ou de réglementation, notamment des administrations fiscales, conformément aux lois et aux règlements applicables. Les Données à caractère personnel peuvent notamment être communiquées à l'administration fiscale luxembourgeoise qui peut,

à son tour, agissant en tant que responsable du traitement des données, communiquer ces dernières aux administrations fiscales étrangères.

Conformément aux conditions prévues par la Législation sur la protection des données, l'investisseur reconnaît ses droits à :

- accéder à ses Données à caractère personnel ;
- rectifier ses Données à caractère personnel lorsque celles-ci sont inexactes ou incomplètes ;
- s'opposer au traitement de ses Données à caractère personnel ;
- limiter l'utilisation de ses Données à caractère personnel ;
- demander l'effacement de ses Données à caractère personnel ;
- et
- demander la portabilité des Données à caractère personnel.

L'investisseur a également le droit de s'opposer à l'utilisation de ses Données à caractère personnel à des fins de marketing en écrivant au Responsable du traitement des données.

L'investisseur peut exercer les droits susmentionnés en écrivant au Responsable du traitement des données à l'adresse e-mail suivante : www.amundi.com – « Contact Us ».

Il est fait état que l'exercice de certains droits peut entraîner, selon le cas, l'impossibilité pour la Société de fournir les services requis.

L'investisseur convient également qu'il est en droit d'introduire une réclamation auprès de la Commission Nationale pour la Protection des Données (« CNPD ») à Luxembourg à l'adresse suivante : 1, avenue du Rock'n'Roll, L-4361 Esch-sur-Alzette, Grand-Duché de Luxembourg, ou auprès de toute autre autorité de contrôle compétente en matière de protection des données.

DROITS DES INVESTISSEURS

La Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que, vis-à-vis de la Société, un investisseur ne pourra exercer pleinement les droits qui lui sont reconnus en tant qu'investisseur que directement, en particulier le droit de participer aux assemblées générales des actionnaires, si cet investisseur est lui-même inscrit sous son propre nom dans le registre des actionnaires de la Société. Lorsqu'un investisseur investit dans la Société par le biais d'un intermédiaire investissant dans la Société en son nom propre mais pour le compte de l'investisseur, cet intermédiaire pourrait ne pas toujours pouvoir exercer certains droits de l'investisseur directement vis-à-vis de la Société. Il est recommandé aux investisseurs de solliciter des conseils à propos de leurs droits.

SOMMAIRE

MULTI UNITS LUXEMBOURG	1
SOMMAIRE	6
I/ OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT / POUVOIRS ET RESTRICTIONS EN MATIERE D'INVESTISSEMENTS ..	11
A. INVESTISSEMENTS EN VALEURS MOBILIÈRES ET ACTIFS LIQUIDES	13
B. INVESTISSEMENTS EFFECTUÉS PAR DES COMPARTIMENTS INDICIELS	17
C. INVESTISSEMENT DANS DES OPCVM	17
D. INVESTISSEMENT DANS D'AUTRES ACTIFS	18
E. TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT	18
II/ VALEUR LIQUIDATIVE	25
III/ CARACTERISTIQUES DES ACTIONS	29
IV/ INVESTIR DANS LA SOCIETE SUR LE MARCHE PRIMAIRE	30
VI/ MARCHE SECONDAIRE DES ETF AYANT LE STATUT D'OPCVM.....	37
VI/ DIVERS	40
ANNEXES.....	54
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi DAX III	55
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi LevDax Daily (2x) leveraged	58
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 II	61
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Australia S&P/ASX 200	64
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Information Technology	67
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Health Care	70
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Financials	73
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll	76
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Equity Quality Income	79
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrat ESG	82
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Pacific Ex Japan	85
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Fed Funds US Dollar Cash	88
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Pan Africa	91
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 5-7Y	94
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 7-10Y	97
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 15+Y	100
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond	103
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 Daily (-2x) Inverse	106
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y	109
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Inflation Expectations 10Y	113
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 1-3Y	116
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 3-7Y	119
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond Long Dated	122
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor iBoxx £ Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF	125
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi UK Government Bond	128
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi UK Government Inflation-Linked Bond	131
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 7-10Y	134
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi UK Government Bond 0-5Y	137
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US TIPS Government Inflation-Linked Bond	140
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Aggregate Green Bond	143
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi FTSE Italia All Cap PIR 2020	146
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI EMU	150
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 1-3Y	153
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 3-5Y	156
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 10-15Y	159
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond II	162
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Inflation-Linked Bond	165

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi FTSE 100	168
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World V	171
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Japan	174
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Asia II	177
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core UK Equity All Cap (DR) UCITS ETF	180
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core US Equity (DR) UCITS ETF	183
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor MSCI World ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF	186
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor German Mid-Cap MDAX UCITS ETF	189
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI All Country World	192
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Nasdaq-100 II	195
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Stoxx Banks	198
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition	201
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi EUR Corporate Bond ex-Financials ESG	205
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture	208
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y	211
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y	214
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI China	217
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Inverse Inflation Expectations 10Y	221
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI China ESG Leaders Extra	224
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI AC Asia Ex Japan	228
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI AC Asia Pacific Ex Japan	231
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Indonesia	234
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened	237
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Brazil	241
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Eastern Europe Ex Russia	244
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Korea	247
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Turkey	250
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Government Inflation-Linked Bond 1-10Y	253
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Europe ESG Leaders	256
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y	259
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Ex China	262
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Government Bond II	265
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core Japanese Government Bond (DR) UCITS ETF	268
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Curve steepening 2-10Y	271
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF	276
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core US Government Bond (DR) UCITS ETF	280
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition	283
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF	287
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Green Bond	291
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Corporate Green Bond	294
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Markets II	297
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Europe Climate Action	300
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Basic Resources	303
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Banks	306
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Consumer Discretionary	309
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Industrials	312
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Insurance	315
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Healthcare	318
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Telecommunications	321
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Utilities	324
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened	327
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Consumer Staples	330
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Basic Materials	333
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Technology	336
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI EMU Value Factor	339

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Gender Equality	342
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened	345
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened	348
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Future Mobility ESG Screened	351
MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Millennials ESG Screened	354
ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE	357
ANNEXE C – RÉCAPITULATIF DES ACTIONS ET DES FRAIS	367
ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DES COMPARTIMENTS .	405
ANNEXE E – OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL	421
ANNEXE F – RÈGLEMENT SUR LES INDICES DE RÉFÉRENCE	425
ANNEXE G – RATIOS D’INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUES	430
ANNEXE H – GLOSSAIRE	433
ANNEXE I - PUBLICATIONS D’INFORMATIONS ESG DE CE PROSPECTUS	438

Répertoire

Siège social

9, rue de Bitbourg,
L-1273 Luxembourg

Promoteur

Amundi Asset Management
91-93 boulevard Pasteur
75015 Paris, France

Conseil d'administration de la Société

Président

Lucien CAYTAN

Administrateur indépendant

Administrateurs

Mehdi BALAFREJ

91-93 boulevard Pasteur
75015 Paris, France

Charles GIRALDEZ

5, allée Scheffer,
L-2520 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Grégory BERTHIER

91-93 boulevard Pasteur
75015 Paris, France

Pierre JOND

5, allée Scheffer,
L-2520 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Société de gestion (également désignée comme le « Gestionnaire »)

Amundi Luxembourg S.A.
5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Gestionnaires de placements

Amundi Asset Management S.A.S
91-93 boulevard Pasteur
75015 Paris, France

Amundi Japan Ltd

Hibiya Dai Building, 1-2-2, Uchisaiwai-cho,
Chiyoda-ku TOKYO #100-0011, Japon

Administration

Dépositaire et agent payeur

Arendt Services S.A.
11, avenue Émile Reuter
L-2420 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Agent Administratif

Arendt Services S.A.
Centre opérationnel :
28-32, Place de la Gare
L-1616 Luxembourg, Grand-Duché du Luxembourg

Agent social et Agent domiciliataire

Arendt Services S.A.
9, rue de Bitbourg,
L-1273 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Agent de Transfert et Teneur de Registre

Arendt Services S.A.
28-32, Place de la Gare
L-1616 Luxembourg, Grand-Duché du Luxembourg

Réviseur d'entreprises

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, rue Gerhard Mercator
L-2182 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Conseiller juridique

Arendt & Medernach S.A.
41A, avenue JF Kennedy
L-2082 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

I/ Objectifs d'investissement / Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements

OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT

La Société a pour but d'offrir des Compartiments gérés par des professionnels et investissant dans une large gamme de valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, conformément à la Partie I de la loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010 sur les organismes de placement collectif (la « **Loi de 2010** »), afin de tirer du capital investi un rendement optimal tout en réduisant le risque inhérent à ses placements grâce à la diversification.

De plus, sauf mention contraire dans l'Annexe concernée, la Société vise à proposer aux investisseurs des Compartiments indiciaires gérés par des professionnels dont l'objectif est de reproduire la composition d'un certain indice financier qui est reconnu par l'autorité de surveillance du Luxembourg.

L'objectif et la politique d'investissement de chaque Compartiment seront énoncés dans l'Annexe qui le concerne et est jointe au présent Prospectus.

Un Compartiment peut poursuivre son objectif d'investissement via une Réplication indirecte et/ou via une Réplication directe, comme décrit dans les paragraphes suivants :

- **un Compartiment recourant à la Réplication indirecte** n'investit pas obligatoirement directement dans les composantes de l'indice financier telles qu'elles sont exposées dans l'Annexe qui le concerne et qui est jointe au présent Prospectus.

L'exposition à la performance de l'indice financier en question sera obtenue au moyen de transactions sur instruments et/ou produits dérivés (la « **Réplication indirecte** »).

a) Si le Compartiment utilise une technique de Réplication indirecte financée pour tout ou partie de ses actifs, il pourra (i) investir dans un panier de valeurs mobilières et d'actifs liquides tel que décrit plus en détail dans la Section A ci-dessous (le « **Portefeuille d'investissements** ») et (ii) conclure une ou plusieurs transactions de swap de gré à gré dans le but de réaliser son objectif d'investissement en échangeant la valeur de son Portefeuille d'investissements contre celle d'un panier de valeurs mobilières ou d'autres actifs éligibles correspondant à son objectif d'investissement. Cette transaction swap de gré à gré est désignée sous le terme de « **Swap non financé** ».

b) Si le Compartiment utilise une technique de Réplication indirecte financée pour tout ou partie de ses actifs, il pourra conclure une transaction de swap de gré à gré afin de réaliser son objectif d'investissement, en échangeant les produits investis contre la valeur d'un panier de valeurs mobilières ou d'autres actifs éligibles correspondant à son objectif d'investissement. Cette transaction swap de gré à gré est désignée sous le terme de « **Swap financé** ». Un Compartiment investissant dans un Swap financé est soumis au Processus de gestion des risques et à la Politique de garanties spécifiés dans le présent Prospectus.

Un Compartiment recourant à la Réplication indirecte peut utiliser simultanément des portefeuilles de Swaps financés ou non financés, sans préjudice des conditions particulières énoncées dans l'Annexe qui le concerne et qui est jointe au présent Prospectus.

Sous réserve qu'un Compartiment réalise son objectif d'investissement en employant un Swap non financé, le panier de titres détenus par le portefeuille d'investissement d'un tel Compartiment sera sélectionné selon les critères d'éligibilité suivants, en particulier :

Lorsque le Compartiment investit dans des actions :

- leur inclusion dans l'un des principaux indices boursiers ;
- la liquidité (elle doit dépasser un seuil minimal de volume de transaction quotidienne et de capitalisation boursière) ;
- la notation du crédit du pays où se trouve le siège de l'émetteur (il doit avoir au moins une notation de crédit minimale ; provenant de S&P, ou son équivalent)
- des critères de diversification de la notation, en particulier en ce qui concerne :
 - l'émetteur (application de ratios d'investissement aux actifs répondant aux critères des OPCVM, en vertu de la Loi de 2010) ;
 - la zone géographique ;
 - le secteur.

Lorsque le Compartiment investit dans des obligations :

Le Compartiment en question investira principalement dans des obligations émises par un pays membre de l'OCDE ou par un émetteur du secteur privé, et libellées dans la devise d'un des pays de l'OCDE.

Les titres susmentionnés seront des obligations sélectionnées selon les critères suivants :

- des critères d'éligibilité, en particulier :
 - la dette senior ;
 - l'échéance fixe ;
 - l'échéance résiduelle maximum ;
 - le volume d'émission minimal ;
 - la note de crédit S&P minimale ou son équivalent.
- des critères de diversification, parmi lesquels :
 - l'émetteur (application de ratios d'investissement aux actifs répondant aux critères des OPCVM, en vertu de la Loi de 2010) ;
 - la zone géographique ;
 - le secteur.

Le panier de titres négociables détenus par le Compartiment peut faire l'objet d'ajustements quotidiens afin que sa valeur soit, en général, au moins égale à 100 % de l'actif net du Compartiment. Lorsque cela est nécessaire, cet ajustement sera effectué de sorte que la valeur de marché du contrat de Swap de gré à gré visé ci-dessus soit négative ou nulle, ce qui permettra de neutraliser le risque de contrepartie généré par le Swap de gré à gré.

Les investisseurs peuvent obtenir des informations supplémentaires concernant les critères d'éligibilité et de diversification, et notamment la liste des indices éligibles, sur le site Internet d'Amundi à l'adresse www.amundiETF.com.

Des informations sur la composition actualisée du panier de titres détenus par le Compartiment et le risque de contrepartie résultant de l'utilisation du Swap de gré à gré sont disponibles sur la page dédiée au Compartiment accessible sur le site Internet d'Amundi à l'adresse www.amundiETF.com.

La fréquence des mises à jour et/ou la date d'actualisation des informations mentionnées ci-dessus est également précisée sur la même page du site Internet mentionné ci-dessus.

La contrepartie au Swap de gré à gré est un établissement financier de premier rang se spécialisant dans ce type de transaction. Cette contrepartie ne jouira d'aucun pouvoir discrétionnaire quant à la composition du portefeuille du Compartiment ou à l'actif sous-jacent des instruments financiers dérivés.

En l'absence de mention contraire dans l'Annexe consacrée à chaque Compartiment, l'emploi du Swap de gré à gré ne donnera pas lieu à un effet de levier.

La valeur liquidative du Compartiment augmentera (ou diminuera) avec la valorisation du Swap de gré à gré.

Les ajustements de la valeur nominale des contrats de Swap de gré à gré du fait d'éventuels rachats et souscriptions seront effectués selon la méthode de l'évaluation au prix du marché.

La valorisation des contrats de Swap de gré à gré sera fournie par la contrepartie, mais la Société de gestion la contrôlera aussi de son côté.

La valorisation des contrats de Swap de gré à gré sera vérifiée par le réviseur d'entreprises de la Société pendant sa mission de vérification annuelle des comptes.

Malgré toutes les mesures prises par la Société pour atteindre ses objectifs, ceux-ci sont sujets à des facteurs de risque indépendants tels que l'évolution de la réglementation fiscale ou commerciale. Il ne peut être donné aux investisseurs aucune garantie de quelque sorte que ce soit à ce propos.

- **Un Compartiment recourant à la technique de Réplication directe** peut réaliser son objectif d'investissement en investissant dans un portefeuille de titres négociables ou autres actifs éligibles incluant généralement les composantes de l'indice financier telles qu'elles sont exposées dans l'Annexe qui le concerne et qui est jointe au présent Prospectus, et appliquera pour ce faire les seuils d'investissement tels qu'ils sont exposés dans le chapitre « Objectifs d'investissement / Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements » ci-dessus.

Afin d'optimiser cette méthode de Réplication Directe et de réduire les coûts associés aux investissements directs dans toutes les composantes de l'indice financier, le Compartiment peut avoir recours à une technique « d'échantillonnage » qui consiste à investir dans une sélection de titres représentatifs composant l'indice financier tels qu'ils sont exposés dans l'Annexe qui le concerne et qui est jointe au présent Prospectus.

Selon cette technique d'échantillonnage, un Compartiment pourrait investir dans une sélection de titres négociables représentatifs de l'indice financier, tels qu'ils sont exposés dans l'Annexe qui le concerne et qui est jointe au présent Prospectus, dans des proportions différentes de celles de l'indice financier, ou bien même investir dans des titres autres que les composantes de l'indice financier.

Lorsque cela est indiqué dans l'Annexe du Compartiment pertinent, le Compartiment se réserve le droit de ne pas investir dans (i) des titres de sociétés impliquées dans la production ou la vente des armes controversées suivantes : mines antipersonnel et bombes à sous-munitions, armes chimiques, biologiques et à l'uranium appauvri, (ii) dans des titres de sociétés

en violation des conventions internationales sur les droits de l'Homme ou du travail ou qui violent, de manière répétée et grave, un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial*, et/ou (iii) dans des titres de sociétés impliquées dans la production ou la distribution de Tabac ou de sociétés ayant une exposition significative au charbon thermique, aux armes nucléaires ou au pétrole et au gaz non conventionnels. Ces titres sont exclus selon la méthodologie d'Amundi.

*Pacte mondial des Nations unies (Pacte mondial de l'ONU) : « demande aux entreprises d'aligner leurs stratégies et leurs opérations sur les dix principes universels liés aux droits de l'homme, au travail, à l'environnement et à la lutte contre la corruption ainsi que de prendre des mesures pour faire progresser les objectifs sociétaux. »

Ces titres sont exclus selon la méthodologie d'Amundi décrite à la Section « Aperçu de la politique d'investissement responsable ».

En outre, un Compartiment recourant à la technique de Réplication directe peut, dans une certaine mesure, se livrer à des transactions sur des obligations structurées ou des instruments financiers dérivés (« IFD »), principalement pour atteindre les objectifs définis aux alinéas (i) et (ii) ci-dessous, qui peuvent comprendre des transactions sur contrats de futures, swaps de gré à gré, swaps de couverture, contrats à terme (forward), contrats à terme non livrables, transactions de change au comptant, afin de :

- i. réduire les écarts de suivi
ou
- ii. optimiser la gestion de sa trésorerie
ou
- iii. réduire les coûts de transaction ou permettre l'investissement dans le cas de titres illiquides ou indisponibles pour des raisons réglementaires ou ayant trait au marché (notamment dans le cas d'une exposition à des pays émergents),
ou
- iv. contribuer à la réalisation de l'objectif d'investissement et permettre par exemple une meilleure efficacité de l'investissement sur l'indice financier ou sur ses composantes,
ou
- v. pour d'autres raisons que les Administrateurs jugent bénéfiques pour le Compartiment.

Si, sous certaines circonstances, un Compartiment venait à conclure un contrat IFD, la contrepartie de cet IFD serait une institution financière de premier rang spécialisée dans ce type de transaction. Cette contrepartie ne jouira d'aucun pouvoir discrétionnaire quant à la composition du portefeuille du Compartiment ou à l'actif sous-jacent des instruments financiers dérivés.

Afin de permettre aux investisseurs de bénéficier d'une transparence sur la méthode de Réplication directe (réplication intégrale de l'indice financier ou échantillonnage pour limiter les coûts de réplication) et sur ses conséquences au niveau des actifs dans le portefeuille du Compartiment, des informations concernant la composition actualisée du panier d'actifs détenus par le Compartiment sont disponibles sur la page dédiée au Compartiment accessible sur le site d'Amundi à l'adresse www.amundiETF.com, sauf mention contraire dans l'Annexe du Compartiment. La fréquence des mises à jour et/ou la date d'actualisation des informations mentionnées ci-dessus est également précisée sur la même page du site Internet mentionné ci-dessus.

POUVOIRS ET RESTRICTIONS EN MATIÈRE D'INVESTISSEMENTS

Pour atteindre les objectifs d'investissement de la Société, le Conseil d'administration a décidé que tous les investissements de la Société seront soumis aux pouvoirs et restrictions ci-après :

A. INVESTISSEMENTS EN VALEURS MOBILIÈRES ET ACTIFS LIQUIDES

- 1) Pour atteindre les objectifs et appliquer les politiques d'investissement de la Société, le Conseil d'administration a décidé que tous les investissements effectués par certains Compartiments de la Société seront soumis aux pouvoirs et restrictions ci-après :
Au titre de certains Compartiments, la Société ne peut investir que dans :
 - a) des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle ou négociés sur un marché réglementé au sens de l'article 4, point 1.4 de la Directive 2004/39/CE ;
 - b) des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un autre marché réglementé qui fonctionne régulièrement et est reconnu et ouvert au public (un « **Marché réglementé** ») dans un État membre tel qu'il est défini dans la Loi de 2010 (« État membre ») ;
 - c) des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une Bourse ou négociés sur un autre Marché réglementé situé dans un autre pays d'Europe, d'Asie, d'Océanie, d'Afrique ou des Amériques ;
 - d) des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis récemment, sous réserve que :
 - i) les conditions dont leur émission est assortie prévoient que sera déposée une demande d'admission à la cote officielle de l'un quelconque des marchés réglementés ou Bourses auxquels il est fait référence ci-dessus ;

- ii) cette admission soit obtenue dans un délai d'un an à compter de leur émission.
- e) les unités, parts ou actions d'OPCVM autorisés selon la Directive 2009/65/EC, qu'ils soient situés ou non dans un État membre, sous réserve que les OPCVM dans lesquels un Compartiment de la Société a l'intention d'investir ne puissent, en vertu de leurs documents constitutifs, consacrer au total plus de 10 % de leur actif net à des unités, parts ou actions d'autres OPCVM ou OPC.
- Les limites de diversification s'appliquant aux investissements en unités, parts ou actions d'OPCVM qui sont décrites dans le présent alinéa sont énoncées dans l'annexe de chaque Compartiment.
- f) des dépôts auprès d'établissements de crédit qui sont remboursables à vue ou peuvent être retirés et arrivent à échéance au plus tard dans 12 (douze) mois, sous réserve que cet établissement de crédit ait son siège social dans un État membre ou, si le siège social de cet établissement de crédit est situé dans un pays membre de l'OCDE adhérant au GAFI, sous réserve qu'il soit soumis à des règles prudentielles que l'Autorité de surveillance du Luxembourg considère équivalentes à celles prévues par le droit de l'Union européenne ;
- g) des instruments financiers dérivés, y compris des instruments réglés au comptant, qui sont négociés sur un Marché réglementé auquel il est fait référence dans les alinéas a), b), c) et/ou des instruments financiers dérivés négociés de gré à gré (« Produits Dérivés de gré à gré »), sous réserve que :
- i) l'actif sous-jacent soit constitué d'instruments couverts par le paragraphe 1) ci-dessus (points a) à f), d'indices financiers, de taux d'intérêt, de taux de change ou de devises dans lesquels chacun des Compartiments peut investir conformément à son objectif d'investissement ;
 - ii) les contreparties aux transactions sur produits dérivés de gré à gré soient des institutions soumises à une surveillance prudentielle et appartenant à une catégorie approuvée par l'Autorité de surveillance du Luxembourg ;
 - iii) et les produits dérivés de gré à gré fassent quotidiennement l'objet d'une évaluation fiable et vérifiable et puissent être vendus, liquidés ou débouclés à tout instant à leur juste valeur par la Société au moyen d'une transaction de sens inverse.
- h) instruments du marché monétaire autres que ceux qui sont négociés sur un Marché réglementé et auxquels fait référence l'Article 1 de la Loi de 2010, si l'émission elle-même ou l'émetteur de ces instruments lui-même est soumis à une réglementation aux fins de protéger les investisseurs et l'épargne et sous réserve qu'ils soient :
- i) émis ou garantis par un État central, ses régions ou collectivités locales, une banque centrale d'un État membre, la Banque centrale européenne, l'Union européenne ou la Banque européenne d'investissement, un État qui n'est pas un État membre ou, dans le cas d'un État fédéral, par l'un des membres composant sa fédération, ou encore par un organisme public international auquel adhèrent un ou plusieurs États membres, ou
 - ii) émis par une entreprise dont les titres sont négociés sur un Marché réglementé auquel il est fait référence dans les alinéas a), b) ou c) ; ou
 - iii) émis ou garantis par un établissement soumis à une surveillance prudentielle conformément aux critères définis par le droit de l'Union européenne, ou par un établissement soumis à et qui se conforme à des règles prudentielles dont l'Autorité de surveillance du Luxembourg juge qu'elles sont au moins équivalentes à celles que prévoit le droit de l'Union européenne ; ou
 - iv) émis ou garantis par d'autres organismes ressortissant aux catégories approuvées par l'Autorité de surveillance du Luxembourg, sous réserve que les investissements dans ces instruments fassent l'objet d'une protection des investisseurs équivalente à celle qui est prévue par les premier, deuxième et troisième alinéas ci-dessus et sous réserve que l'émetteur soit une société dont les fonds propres se montent à au moins dix millions d'euros (10 000 000 EUR) et qu'elle présente et publie ses comptes annuels conformément à la Directive 2013/34/EU, qu'elle soit une entité qui, au sein d'un groupe de sociétés incluant une ou plusieurs sociétés cotées, est spécialisée dans le financement de ce groupe ou est une entité spécialisée dans le financement de véhicules de titrisation et

bénéficiant d'une ligne de liquidité bancaire.

- 2) En outre, tout Compartiment de la Société peut investir au maximum 10 % de son actif net dans des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire autres que ceux visés au paragraphe (1).

- 3) À l'exception de situations de conditions de marché exceptionnellement défavorables où un dépassement temporaire de la limite de 20 % est requis par les circonstances et justifié au regard de l'intérêt des investisseurs, chaque Compartiment peut détenir jusqu'à 20 % de ses actifs nets en dépôts bancaires à vue accessibles à tout moment, afin de couvrir des paiements courants ou exceptionnels ou pendant le temps nécessaire au réinvestissement dans des actifs éligibles ou pendant une période de temps strictement nécessaire en cas de conditions de marché défavorables.

4)

- a) Un Compartiment ne peut investir plus de 10 % de son actif net dans des valeurs mobilières ou instruments du marché monétaire émis par un même émetteur.

Un Compartiment ne peut investir plus de 20 % de son actif net dans des dépôts auprès d'un même émetteur. L'exposition au risque de contrepartie d'un Compartiment qui est partie à une transaction sur produit dérivé de gré à gré ne doit pas excéder 10 % de son actif net si cette contrepartie est un établissement de crédit auquel il est fait référence dans le paragraphe (1) f) ci-dessus, ou 5 % de son actif net dans les autres cas.

- b) En sus de la limite énoncée au point a) ci-dessus, la valeur totale des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire qui excède 5 % de l'actif net d'un Compartiment ne doit pas dépasser 40 % de l'actif net de ce Compartiment. Cette limite ne s'applique pas aux dépôts confiés à et transactions sur Produits dérivés de gré à gré effectuées avec des établissements financiers soumis à une surveillance prudentielle.
- c) Nonobstant les différentes limites spécifiées dans le paragraphe a), b) ci-dessus, un Compartiment ne peut combiner aucun des éléments ci-après :

investissements dans des titres négociables ou instruments du marché monétaire émis par,

- i) dépôts confiés à,

- ii) des expositions résultant de transactions sur instruments dérivés de gré à gré avec un émetteur unique, pour plus de 20 % de l'Actif net du Compartiment.
- d) la limite de 10 % qui est stipulée à l'alinéa 4 a) ci-dessus peut être portée à 35 % au maximum pour des titres négociables et instruments du marché monétaire qui sont émis ou garantis par un État membre ou ses collectivités locales, par un pays membre de l'OCDE adhérant au GAFI ou par des organismes publics internationaux auxquels adhèrent un ou plusieurs États membres, auquel cas ces titres et instruments du marché monétaire n'ont pas besoin d'être pris en compte dans le calcul de la limite de 40 % qui est stipulée à l'alinéa 4) b).
- e) la limite de 10 % qui est stipulée à l'alinéa 4 a) ci-dessus peut être portée à 25 % au maximum pour les obligations qui correspondent à la définition des obligations garanties du point (1) de l'Article 3 de la Directive (UE) 2019/2162 du Parlement Européen et du Conseil du 27 novembre 2019 concernant l'émission d'obligations garanties et la surveillance publique des obligations garanties, et pour les titres de créance remplissant les conditions requises et émis avant le 8 juillet 2022 par un établissement de crédit dont le siège social se trouve dans un État membre et qui, en vertu de la loi, est soumis par les autorités à une surveillance particulière afin de protéger les détenteurs de ces titres de créance. Aux fins des présentes, sont considérés comme des « titres de créance remplissant les conditions requises » les titres dont le produit est investi conformément à la législation en vigueur dans des actifs procurant une rémunération qui couvrira le service de la dette jusqu'à la date d'échéance de ces titres et qui sera consacrée en priorité au paiement du principal et des intérêts en cas de défaillance de l'émetteur. Dans la mesure où un Compartiment investit plus de 5 % de son actif net dans des titres de créance provenant d'un tel émetteur, la valeur totale de ces investissements ne doit pas dépasser 80 % de l'actif net du Compartiment. Il n'est pas nécessaire que ces titres soient pris en compte dans le calcul de la limite de 40 % qui est énoncée dans le paragraphe 4 b).

Les plafonds stipulés dans le paragraphe 4) ci-dessus ne sont pas cumulatifs et, en conséquence, les investissements dans les titres d'un même émetteur qui sont effectués conformément aux dispositions énoncées dans le paragraphe 4 ne

doivent en aucun cas dépasser 35 % de l'actif net d'un quelconque Compartiment.

- f) Les sociétés faisant partie d'un même groupe aux fins de ses comptes consolidés (tel que défini par la Directive 2013/34/UE) ou qui sont considérées, au regard des règles comptables internationalement reconnues, comme un seul et même organisme ou émetteur aux fins du calcul des limites stipulées dans la présente section.

Tout Compartiment peut investir au total jusqu'à 20 % de son actif net dans des titres négociables et instruments du marché monétaire émis par un même groupe.

- 5) Nonobstant les plafonds énoncés ci-dessus, tout Compartiment est autorisé à investir, en respectant les principes de diversification des risques, jusqu'à 100 % de son actif net dans des valeurs mobilières ou instruments du marché monétaire émis ou garantis par (i) un État membre de l'Union européenne, ses collectivités locales, ou des organismes publics internationaux auxquels adhèrent un ou plusieurs États membres de l'Union européenne, (ii) tout État membre de l'OCDE ou tout pays membre du G20, ou (iii) Singapour ou Hong Kong, sous réserve que :
- a) ces valeurs soient réparties en au moins six émissions différentes ; et
 - b) les valeurs d'une émission donnée n'excèdent pas 30 % de l'actif net du Compartiment.

Cette autorisation sera accordée si les actionnaires bénéficient d'une protection équivalente à celle dont jouissent les actionnaires des OPCVM respectant les limites énoncées dans le paragraphe 4) ci-dessus.

- 6) La Société n'est pas autorisée à :
- a) ne peut acquérir plus de 10 % des titres de créance d'un même émetteur ;
 - b) acquérir plus de 10 % d'actions sans droit de vote d'un même émetteur ;
 - c) acquérir plus de 10 % d'instruments du marché monétaire d'un même émetteur ;
 - d) acquérir plus de 25 % des unités, parts ou actions d'un même organisme de placement collectif.

Les quatre limites ci-dessus s'appliquent à la Société considérée dans son ensemble.

Il peut ne pas être tenu compte des limites prévues par les alinéas a), c) et d) ci-dessus au moment de l'acquisition si, à ce moment, le montant brut des obligations ou instruments du marché monétaire ou le

montant net des instruments en circulation ne peut être calculé.

La Société n'a pas le droit d'acquérir de quelconques actions avec droit de vote qui lui permettraient de prendre le contrôle juridique ou la direction de l'organisme émetteur ou d'exercer une influence significative sur la direction de celui-ci.

- 7) Les limites énoncées au paragraphe 6) ci-dessus ne s'appliquent pas :
- a) Aux valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis ou garantis par un État membre ou ses collectivités locales ;
 - b) valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis ou garantis par un autre État qui n'est pas un État Membre ;
 - c) aux valeurs mobilières et instruments du marché monétaire émis par un organisme public international auquel adhèrent un ou plusieurs États membres ;
 - d) aux actions formant le capital d'une société constituée en vertu de ou conformément aux lois d'un État qui n'est pas un État membre sous réserve que (i) cette société investisse son actif principalement dans des titres émis par des émetteurs de cet État (ii) selon la législation de cet État, une participation du Compartiment concerné dans le capital de ce véhicule soit le seul moyen possible d'acheter des titres d'émetteurs de cet État et (iii) dans sa politique d'investissement, ce véhicule observe les restrictions énoncées dans les paragraphes 4) et 5) ci-dessus ainsi que dans le paragraphe C. ci-après ;
 - e) aux actions que la Société détient dans le capital de filiales se livrant exclusivement à une activité de gestion, de conseil ou de commercialisation de la Société dans le pays/État où cette filiale est située pour le rachat d'unités, parts ou actions demandé par les titulaires d'unités ou de parts/actionnaires.

Les restrictions sur les investissements énumérées ci-dessus et en C. ci-après s'appliquent au moment où sont achetés les investissements en question. Si un Compartiment dépasse ces limites pour des raisons indépendantes de sa volonté ou lorsqu'il exerce des droits de souscription, ce Compartiment se donnera pour objectif prioritaire, lorsqu'il procède à des ventes, de remédier à cette situation en prenant dûment en compte les intérêts des Actionnaires.

Tout en ayant soin de respecter le principe de répartition des risques, la Société peut déroger

aux limitations énoncées dans les paragraphes 4) à 7) ci-dessus et en **C.** ci-après pendant une durée de six mois à partir de la date de son inscription à la cote officielle des OPC au Luxembourg.

- 8) La Société veillera à ce que l'exposition globale résultant de l'emploi d'instruments dérivés par un Compartiment n'excède pas la valeur totale de son actif. L'exposition aux risques est calculée en prenant en compte la valeur actuelle des actifs sous-jacents, le risque de contrepartie, les évolutions futures du marché et le temps restant pour liquider les positions.

Si un Compartiment investit dans des instruments financiers dérivés, l'exposition totale aux actifs sous-jacents ne doit pas dépasser les limites énoncées dans le paragraphe A. 4) ci-dessus. Quand le Compartiment investit dans des instruments financiers dérivés reposant sur un indice, ils n'ont pas à être combinés pour le calcul des limites énoncées dans le paragraphe A. 4).

Si un instrument dérivé est intégré dans une valeur mobilière ou un instrument du marché monétaire, cet instrument dérivé doit être pris en compte dans le calcul des limites à respecter qui sont énoncées ci-dessus.

B. INVESTISSEMENTS EFFECTUÉS PAR DES COMPARTIMENTS INDICIELS

La finalité de la politique d'investissement des Compartiments indicieux est de reproduire la composition d'un certain indice financier reconnu par la CSSF aux conditions ci-après :

- a) la composition de l'indice est suffisamment diversifiée ;
- b) l'indice est un indice de référence reflétant fidèlement le marché auquel il se rapporte ;
- c) il est publié selon des modalités appropriées.

En raison de la politique d'investissement spécifique des Compartiments indicieux et sans préjudice des limites énoncées dans le paragraphe A. 6) et 7), les plafonds stipulés dans le paragraphe A. 4) sont portés à 20 % au maximum pour les investissements en actions et/ou obligations émises par un même organisme. Le plafond ci-dessus est porté à 35 % si cela s'avère justifié par des conditions de marché exceptionnelles, en particulier sur les Marchés réglementés où certains titres négociables ou instruments du marché monétaire tiennent une place prédominante comme cela (le cas échéant) est expliqué de façon plus approfondie dans les Annexes. Il n'est permis d'investir jusqu'à cette limite que pour un seul émetteur.

Licence

L'utilisation d'un indice financier par un Compartiment fait l'objet d'un contrat de licence (la « **Licence** »). Il n'existe aucune garantie que la Licence sera prorogée au-delà de son échéance initiale ou qu'elle ne sera pas résiliée.

Substitution d'indice

Dans le cas où la Licence ne serait pas renouvelée ou si elle était résiliée, la Société de gestion pourra, avec l'accord du Conseil d'administration, tenter de remplacer l'indice financier par un autre indice adéquat, encore qu'il ne soit nullement certain qu'un tel indice existe à ce moment.

Il n'existe aucune garantie que la méthode de construction d'un indice financier telle qu'elle est décrite dans l'Annexe d'un Compartiment ne sera pas modifiée par l'administrateur de l'indice. Dans le cas où elle subirait une modification notable, le Gestionnaire, avec l'accord des Administrateurs, pourra décider à sa discrétion de remplacer l'Indice par un autre indice adéquat si un tel indice existe à ce moment.

Les Actionnaires seront informés dans les plus brefs délais si la Licence est résiliée et/ou si l'indice est remplacé.

C. INVESTISSEMENT DANS DES OPCVM

Certains Compartiments peuvent acquérir des unités d'OPCVM auxquels il est fait référence dans le paragraphe A. 1) e) ci-dessus, à condition que 10 % au plus de l'actif net d'un tel Compartiment soit investi dans ces unités. Aucun Compartiment ne peut acquérir de parts ou d'unités d'OPC.

Si un Compartiment de la Société investit dans des unités d'OPCVM qui sont gérés, directement ou indirectement, par la Société de gestion ou par toute autre société à laquelle la Société de gestion est liée par une direction ou un contrôle communs ou par une participation substantielle, directe ou indirecte, qui dépasse 10 % du capital ou des droits de vote, aucune commission de souscription ou de rachat ne peut être prélevée par la Société au titre de ses investissements dans les unités de ces autres OPCVM. De plus, la Société ne peut se voir réclamer aucune commission de souscription ou de rachat du fait d'un investissement dans les unités d'OPCVM sous-jacents.

La Société n'a pas le droit d'acquérir plus de 25 % des unités d'un même OPCVM. Il peut ne pas être tenu compte de cette limite si, au moment de l'acquisition, il est impossible de calculer la valeur brute des unités en circulation au moment de leur acquisition. Dans le cas d'un OPCVM à compartiments multiples, cette restriction s'applique en se référant à la totalité des unités émises par l'OPCVM concerné, tous compartiments confondus.

Les investissements sous-jacents qui sont détenus par les OPCVM dans lesquels la Société investit n'ont pas à être pris en compte aux fins

des restrictions sur les investissements énoncées en A ci-dessus.

D. INVESTISSEMENT DANS D'AUTRES ACTIFS

a) La Société n'effectuera pas d'investissements dans les métaux précieux ou les certificats les représentant ;

b) La Société n'a pas le droit de conclure de transactions portant sur des matières premières ou sur des contrats sur matières premières, à cette exception près qu'elle est libre d'employer les techniques et instruments qui sont décrits dans le paragraphe E. ci-dessous, sous réserve des conditions énoncées dans les règlements en vigueur. Afin de lever toute ambiguïté, l'emploi de swaps sur rendement total de gré à gré pour les indices financiers de Matières premières éligibles est autorisé ;

c) La Société n'achètera ni ne vendra de biens immobiliers ni une quelconque option, non plus qu'un quelconque droit sur ou intérêt dans, une option ou des biens immobiliers, mais il lui est loisible d'investir dans des titres garantis par des actifs immobiliers ou des intérêts dans de tels actifs, ou dans des titres émis par des sociétés investissant dans des biens immobiliers ou dans des intérêts dans des biens immobiliers.

La Société est toutefois libre d'acquérir des biens meubles et immeubles qui sont directement nécessaires à l'exercice de son activité ;

d) Il est interdit à la Société d'effectuer des ventes non couvertes de valeurs mobilières, instruments du marché monétaire ou autres instruments financiers auxquels il est fait référence ci-dessus ;

e) La Société ne peut emprunter pour le compte d'un Compartiment que 10 % au maximum de la valeur liquidative de ce compartiment, et ce uniquement à titre temporaire. Aux fins de cette restriction, les prêts adossés ne sont pas considérés comme des emprunts ;

f) La Société n'accordera pas de prêts et ne se portera pas garante pour le compte de tiers. Cette restriction n'interdit pas à la Société d'acquérir des titres négociables, instruments du marché monétaire ou autres instruments financiers auxquels il est fait référence au point 1) ci-dessus ;

g) La Société n'hypothéquera, ne donnera en nantissement et, à titre de garantie pour toute dette, ne consentira de toute autre manière aucun droit grevant sur, de quelconques titres détenus pour le compte de tout Compartiment, sauf si cela est nécessaire en relation avec les emprunts mentionnés au point e) ci-dessus, auquel cas ce nantissement ou hypothèque ne pourra excéder 10 % de la valeur liquidative de ce Compartiment. Le dépôt de titres ou autres actifs sur un compte séparé dans le cadre de contrats de swap ou d'option ou de transactions portant sur des contrats de change de gré à gré (forward) ou standardisés (futures) ne sera pas

considéré comme un nantissement ou une hypothèque à cette fin ;

La Société ne participera à aucun syndicat de placement pour les titres d'autres émetteurs.

En vertu des Restrictions sur les investissements ci-dessus, un Compartiment peut employer des techniques et des instruments ayant trait à des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, sous réserve que ces techniques et instruments soient employés aux fins d'une gestion efficace du portefeuille. Tout Compartiment peut en outre employer des techniques et instruments destinés à lui procurer une protection contre le risque de change dans le cadre de la gestion de ses éléments d'actif et de passif (voir ci-dessous).

Le Conseil d'administration peut imposer à tout instant d'autres restrictions sur les investissements dans l'intérêt des Actionnaires toutes les fois que cela est nécessaire pour se conformer à la législation et la réglementation des pays où les Actions de la Société sont proposées.

E. TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

1) Techniques et instruments relatifs aux valeurs mobilières et instruments du marché monétaire

Sous réserve des conditions énoncées en A. 1) g) ci-dessus et de toutes limites énoncées dans sa politique d'investissement respective, tout Compartiment peut recourir aux techniques et instruments ci-après aux fins d'une gestion efficace du portefeuille.

Aux fins d'une gestion efficace du portefeuille, un Compartiment peut effectuer des transactions sur instruments financiers dérivés tels que des contrats à terme standardisés sur instruments financiers (futures), warrants et options négociés sur un Marché réglementé. À défaut, un Compartiment peut effectuer des transactions sur des options, des swaps (y compris les swaps de rendement total) conclus de gré à gré (OTC) avec des établissements financiers bien notés se spécialisant dans ce type d'opérations et jouant un rôle actif sur le marché de gré à gré de ces instruments. Ces instruments financiers dérivés de gré à gré sont conservés par le Dépositaire.

1. Options sur valeurs mobilières/instruments du marché monétaire

Un Compartiment peut acheter des options d'achat et de vente sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

À la conclusion de et pendant l'existence de contrats de vente d'options d'achat sur des titres, un Compartiment détiendra soit les titres sous-jacents dans une quantité suffisante pour couvrir ces options d'achat, soit d'autres instruments (tels que des bons de souscription) procurant une couverture suffisante pour les engagements résultant de ces transactions.

Les titres sous-jacents sur lesquels portent les options d'achat vendues ne peuvent être cédés tant que ces options sont en cours, sauf si ces

options sont couvertes par des options d'achat à due concurrence ou par d'autres instruments pouvant être employés à cette fin. Il en va de même pour les options d'achat équivalentes ou autres instruments que le Compartiment doit détenir dans le cas où il ne détient pas les titres sous-jacents au moment où il vend ces options.

Un Compartiment ne peut vendre d'options d'achat non couvertes sur des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire. Par dérogation à cette règle, un Compartiment peut vendre des options d'achat sur des titres qu'il ne détient pas au moment où il conclut une transaction si le prix d'exercice total des options d'achat ainsi vendues n'excède pas 25 % de la valeur liquidative de ce Compartiment et s'il est en mesure de couvrir à tout instant la position ouverte résultant de cette transaction.

Si une option de vente est vendue, le portefeuille du Compartiment qui correspond à cette option doit être couvert pendant toute la durée du contrat d'option par des actifs liquides appropriés dont la valeur soit égale à la valeur d'exercice du contrat dans le cas où l'option serait exercée par la contrepartie.

2. Couverture au moyen de contrats à terme standardisés (futures) sur indice boursier, de bons de souscription et d'options

À titre de couverture globale contre le risque de variation défavorable du marché, un Compartiment peut vendre des contrats à terme standardisés (futures) sur des indices boursiers et il lui est également loisible de vendre des options d'achat, d'acheter des options de vente ou d'effectuer des transactions sur des bons de souscription portant sur des indices boursiers sous réserve qu'il existe une corrélation suffisamment étroite entre la composition de l'indice utilisé et celle du portefeuille correspondant de ce Compartiment.

L'engagement total résultant de ces contrats à terme standardisés, d'option et de bons de souscription portant sur des indices boursiers ne doit pas dépasser l'évaluation totale des titres détenus par le portefeuille du Compartiment qui correspond à cet engagement telle qu'elle ressort du marché correspondant à chaque indice.

3. Couverture au moyen de contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt, d'options, de bons de souscription et de swaps (y compris les swaps de rendement total)

À titre de couverture globale contre les variations de taux d'intérêt, un Compartiment peut vendre des contrats à terme standardisés sur taux d'intérêt et il lui est aussi loisible de vendre des options d'achat, d'acheter des options de vente ou d'effectuer des transactions sur des bons de souscription portant sur des taux d'intérêt, ou de conclure des contrats de swap ou d'option sur swap négociés de gré à gré et portant sur des taux d'intérêt avec des établissements financiers bien notés se spécialisant dans ce type d'instruments.

L'engagement total résultant de ces contrats à terme standardisés, options, bons de souscription et contrats de swap (y compris des swaps de rendement total) et d'option sur swap portant sur des taux d'intérêt ne doit pas excéder la valeur de marché totale des actifs à couvrir que détient le Compartiment dans la devise correspondant à ces contrats.

4. Contrats à terme standardisés, bons de souscription et options portant sur d'autres instruments financiers dans un but autre que celui de couverture

À titre de mesure visant à obtenir un portefeuille totalement investi tout en conservant une liquidité suffisante, un Compartiment peut acheter ou vendre des contrats à terme standardisés, bons de souscription et options portant sur des instruments financiers (autres que des valeurs mobilières ou contrats de change) tels que des instruments reposant sur des indices boursiers et taux d'intérêt, sous réserve que ceux-ci soient conformes à la politique et l'objectif d'investissement affichés de ce Compartiment et que l'engagement total résultant de ces transactions, cumulé avec l'engagement total résultant de la vente d'options d'achat et de vente portant sur des valeurs mobilières, n'excède à aucun moment la valeur d'actif net dudit Compartiment.

S'agissant de l'engagement total auquel il est fait référence dans le paragraphe précédent, les options d'achat sur valeurs mobilières vendues par le Compartiment et pour lesquelles il dispose d'une couverture suffisante n'entrent pas dans le calcul de cet engagement total.

L'engagement relatif aux transactions portant sur des instruments autres que des options sur titres négociables sera défini comme suit :

- l'engagement résultant de contrats à terme standardisés est réputé égal à la valeur des positions nettes sous-jacentes qui sont dues au titre de ces contrats et concernent des instruments financiers identiques (après compensation entre toutes les positions vendeuses et acheteuses) sans qu'il soit tenu compte de leurs dates d'échéance respectives et
- l'engagement résultant d'options achetées et vendues et de bons de souscription achetés et vendus est égal au total des prix d'exercice des positions nettes vendeuses non couvertes qui concernent un même actif sous-jacent sans qu'il soit tenu compte de leurs dates d'échéance respective.

Le prix d'acquisition total (mesuré par les primes payées) de toutes les options sur titres négociables qui ont été achetées par un Compartiment, additionné aux options acquises à des fins autres que celle de couverture (voir ci-dessus) ne doit pas dépasser 15 % de l'actif net de ce Compartiment.

5. Swaps sur rendement total négociés de gré à gré

Afin d'atteindre l'objectif d'investissement des Compartiments répliquant des indices financiers via une méthodologie de Réplication indirecte, la Société peut, pour le compte des Compartiments, conclure des swaps de rendement total (« TRS ») dans le cadre de transactions privées (de gré à gré) avec des institutions financières réglementées dont le siège social est sis dans un État membre de l'OCDE, spécialisées dans ce type de transaction, bénéficiant au minimum d'une notation « investment grade » et soumises à une surveillance prudentielle (par exemple, des établissements de crédit ou des sociétés d'investissement). L'identité des contreparties sera indiquée dans le rapport annuel.

En cas de recours aux TRS, chaque Compartiment pourra encourir des frais et commissions lors de la conclusion des contrats et/ou être éventuellement exposé à une hausse ou à une baisse de leur montant notionnel. Le montant de ces commissions peut être fixe ou variable. Le détail des frais et commissions encourus à ce titre par chaque Compartiment, ainsi que l'identité des bénéficiaires et, le cas échéant, leur affiliation avec le Dépositaire, le conseiller en investissement ou la Société de gestion pourront figurer dans le rapport annuel. Tous les revenus découlant des TRS, nets des commissions et frais d'exploitation directs et indirects, reviendront au Compartiment concerné.

Un Compartiment est exposé au risque de faillite, de défaut de paiement ou de tout autre type de défaillance de la contrepartie des swaps de rendement total de gré à gré.

Conformément aux lignes directrices sur les OPCVM, le risque de contrepartie (que la contrepartie soit la Société Générale ou une autre société tierce) ne peut excéder, pour chaque contrepartie, 10 % de l'actif total du Compartiment concerné.

Toute contrepartie à un instrument dérivé de gré à gré conclu par un Compartiment sera sélectionnée conformément aux politiques et procédures de meilleure exécution de la Société de gestion. Une copie de la politique de meilleure exécution de la Société de gestion (y compris la matrice d'exécution pertinente par classe d'actifs) est mentionnée à l'adresse suivante : <https://www.amundi.com>, section Documentation juridique.

Un Compartiment peut conclure des TRS sous la forme de Swaps financés et/ou non financés.

Lorsqu'un Compartiment a recours à des TRS, il en sera fait mention dans le tableau « Opérations de financement sur titres et swaps de rendement total » du Prospectus, au sens et dans les conditions prévues par les lois, réglementations et circulaires applicables occasionnellement émises par la

CSSF, notamment par la réglementation (UE) 2015/2365.

6. Techniques de gestion efficace de portefeuille

La Société peut recourir à des techniques et instruments ayant trait à des titres négociables et instruments du marché monétaire, sous réserve que ces techniques et instruments soient employés aux fins d'une gestion efficace du portefeuille au sens et dans les conditions spécifiées par les lois, réglementations et circulaires applicables occasionnellement émises par la CSSF.

En particulier, ces techniques ou instruments ne sauraient entraîner de changement de l'objectif d'investissement du Compartiment ni induire d'importants risques supplémentaires par rapport au profil de risque indiqué pour ce Compartiment. Ces valeurs ou instruments seront conservés auprès du Dépositaire.

Il est nécessaire de tenir compte de l'exposition au risque de contrepartie résultant de l'utilisation combinée de techniques de gestion de portefeuille efficaces et d'instruments financiers dérivés négociés de gré à gré afin de calculer les limites de ce risque définies à l'article 52 de la Directive 2009.

Tous les revenus générés par les techniques de gestion de portefeuille efficaces seront restitués au Compartiment concerné, après déduction des frais d'exploitation directs ou indirects et des commissions. En particulier, des commissions et des frais pourront être payés à des agents de la Société, à la Société de gestion ou à tous autres intermédiaires fournissant des services dans le cadre de techniques de gestion efficace de portefeuille à titre de rémunération normale de leurs services. Ces commissions peuvent être calculées selon un pourcentage des revenus bruts perçus par le Compartiment de par l'utilisation de ces techniques. Les informations relatives aux frais d'exploitation directs ou indirects et aux commissions qui peuvent être encourus dans ce contexte et l'identité des entités qui les perçoivent – ainsi que leurs éventuelles relations avec le Dépositaire ou la Société de gestion – seront disponibles dans le rapport annuel de la Société.

(a) Opérations de prêt et d'emprunt de titres

Plusieurs Compartiments de la Société ont l'intention de conclure des opérations de prêt et d'emprunt de titres, à savoir des transactions dans le cadre desquelles un prêteur transfère des titres ou des instruments à un emprunteur, à condition que ce dernier s'engage à lui restituer des titres ou instruments équivalents à une date ultérieure ou lorsque le prêteur lui en fait la demande. Une telle transaction est considérée comme un prêt de titres pour la partie qui transfère les titres ou instruments, et comme un emprunt de titres pour la contrepartie à laquelle ils sont transférés. Les titres et instruments pouvant faire l'objet d'opérations de prêt

comprennent les actions, les obligations, les instruments du marché monétaire et les fonds négociés en bourse. Les opérations de prêts de titres peuvent être réalisées à l'une ou plusieurs des fins suivantes : (i) la réduction du risque ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération de capital ou de revenus supplémentaires en fonction des revenus et des coûts attendus de l'opération, qui sont essentiellement déterminés par la demande de titres détenus dans le portefeuille de chaque fonds par l'emprunteur. À ce titre, il est prévu que les Compartiments s'engagent dans ce type de transactions sur une base temporaire.

La Société a en particulier l'intention de conclure des opérations de prêt de titres lorsque, outre les conditions précitées, les règles suivantes sont respectées :

- l'emprunteur dans une opération de prêt de titres doit être un établissement financier réglementé dont le siège social est sis dans un État membre de l'OCDE, spécialisé dans ce type de transaction, bénéficiant au minimum d'une notation « investment grade » et soumis à une surveillance prudentielle (comme, par exemple, un établissement de crédit ou une société d'investissement). L'identité de l'emprunteur sera indiquée dans le rapport annuel ;
- la Société peut uniquement prêter des titres ou des instruments à un emprunteur, directement ou via un système normalisé organisé par un organisme de compensation reconnu ou via un système de prêt organisé par une institution financière spécialisée dans ce type d'opérations et soumise à des règles de contrôle prudentiel jugées équivalentes par le CSSF à celles prescrites par le droit communautaire ;
- la Société ne peut conclure des opérations de prêt de titres qu'à condition qu'elle ait le droit, en vertu des termes de l'accord, de demander à tout moment la restitution des titres prêtés ou de résilier l'accord.

Pour certains Compartiments, la Société et la Société de Gestion ont désigné Amundi Intermediation comme agent de prêt de titres (l'« **Agent de prêt de titres** »).

L'Agent de prêt de titres est chargé de la sélection des contreparties et de la meilleure exécution.

Les opérations de prêt de titres peuvent être exécutées avec des parties liées, appartenant au Groupe Crédit Agricole, telles que Crédit Agricole CIB et CACEIS. Les contreparties avec lesquelles les opérations de prêt de titres sont conclues seront détaillées dans le rapport annuel de la Société.

Les revenus nets (qui représentent les revenus bruts moins les coûts et commissions opérationnels directs et indirects) obtenus à partir des techniques et instruments sur les opérations de financement de titres restent au sein du Compartiment concerné.

Les coûts et commissions opérationnels directs et indirects peuvent être déduits des revenus bruts remis au Compartiment. Sauf indication contraire dans l'Annexe du Compartiment concerné, ces coûts représentent 35 % des revenus bruts et sont payés à l'Agent de prêt de titres.

Sur les 35 % qu'il reçoit, l'Agent de prêt de titres couvre ses propres commissions et coûts et paie toute commission et tout coût indirect pertinent (y compris 5 % à Caceis Bank, succursale de Luxembourg, agissant en tant qu'agent de garantie et effectuant le règlement des opérations de prêt de titres).

Étant donné que ces commissions et frais d'exploitation directs et indirects n'augmentent pas les coûts d'exploitation de ce Compartiment, ils sont exclus des charges courantes.

Au moins 65 % des revenus bruts vont au Compartiment concerné.

Les Compartiments qui concluent des prêts de titres pourraient être affectés par de fortes variations des opportunités de marché. Le volume d'utilisation de cette technique en vue d'optimiser les revenus est susceptible d'être affecté par le rendement attendu compte tenu de l'appétit du marché. En période de forte demande (par exemple, demande d'emprunt d'actions sur le marché sous-jacent), la proportion des actifs nets des Compartiments faisant l'objet d'opérations de prêts de titres peut approcher le pourcentage maximum, alors qu'il peut également y avoir des périodes durant lesquelles la demande d'emprunt des titres sous-jacents par le marché est faible ou inexistante, auquel cas cette proportion peut être de 0 %. Par ailleurs, les Compartiments peuvent également être affectés par l'adaptation continue du marché au nouveau cadre réglementaire mis en place. Le recours au prêt de titres ne dépassera pas le niveau maximum indiqué en Annexe E, ces maximums étant déterminés par les contraintes de gestion.

L'Agent de prêt de titres et Caceis Bank, succursale de Luxembourg, sont des parties liées à la Société de gestion.

Afin de lever toute ambiguïté, les opérations de prêt de titres seront limitées aux compartiments qui mettent en œuvre une politique d'investissement fondée sur une technique de Réplication directe.

Le rapport annuel de la Société contient, s'il y a lieu, les détails suivants :

- le niveau d'exposition résultant de l'utilisation de techniques de gestion de portefeuille efficaces ;
- l'identité de la/des contrepartie(s) à ces techniques de gestion de portefeuille efficaces ;
- le type et le montant des garanties reçues par la SICAV afin de réduire l'exposition au risque de contrepartie ; et
- les revenus générés par les techniques de gestion de portefeuille efficaces sur l'intégralité de la période considérée, ainsi que les frais d'exploitation directs ou indirects et les commissions encourus.

Le recours par tout Compartiment à des opérations de prêt et d'emprunt de titres sera précisé dans le tableau « Opérations de financement sur titres et swaps de rendement total » du Prospectus, au sens et dans les conditions énoncés dans les lois, réglementations et circulaires CSSF applicables publiées de temps à autre, en particulier, mais sans s'y limiter, le Règlement (UE) 2015/2365.

(b) Opérations de mise en pension, de prise en pension et d'achat-revente

La Société peut conclure des accords de mise en pension qui consistent en des opérations à terme (forwards) à l'échéance desquelles elle (le vendeur) a l'obligation de racheter les actifs vendus et la contrepartie (l'acheteur) a l'obligation de restituer les actifs achetés en vertu de ces opérations. La Société peut également conclure des accords de prise en pension qui consistent en des opérations à terme à l'échéance desquelles la contrepartie (le vendeur) est tenue de racheter les actifs vendus et la Société (l'acheteur) de restituer les actifs achetés dans le cadre de ces opérations.

L'engagement de la Société dans ces opérations est toutefois soumis aux règles suivantes :

- la contrepartie pour ces opérations doit être un établissement financier réglementé dont le siège social est sis dans un État membre de l'OCDE, spécialisé dans ce type de transaction, bénéficiant au minimum d'une notation « investment grade » et soumis à une surveillance prudentielle (comme, par exemple, un établissement de crédit ou une société d'investissement). L'identité de la contrepartie sera indiquée dans le rapport annuel ;
- la Société ne peut conclure un accord de prise en pension et / ou de mise en pension que si elle est en mesure à tout moment (a) de rappeler le montant intégral des espèces engagé dans une prise en pension ou tout titre sujet à une mise en pension, ou b) de résilier l'accord, conformément aux réglementations en vigueur. Toutefois, les opérations à terme qui ne dépassent

pas sept jours devraient être considérées comme des accords dont les modalités permettent à la Société de rappeler les actifs à tout moment.

La Société peut conclure des opérations d'achat-revente, à savoir des transactions non régies par un contrat de mise ou de prise en pension tel que susmentionné en vertu desquelles une partie achète ou vend des titres ou instruments à une contrepartie, en acceptant de vendre ou de racheter des titres ou instruments de même nature à la contrepartie selon un prix convenu à une date ultérieure. On parle généralement d'opération d'achat-revente pour la partie qui achète les titres ou instruments, et d'opération de vente-rachat pour la contrepartie qui les vend.

Lorsqu'un Compartiment a recours à des opérations de mise en pension, de prise en pension et d'achat-revente, il en est fait mention dans le tableau « Opérations de financement sur titres et swaps de rendement total ». A la date du Prospectus, les Compartiments ne se sont pas engagés et n'ont aucune intention de s'engager dans des opérations de rachat, y compris les opérations de prise en pension et d'achat-revente.

Si un Compartiment s'engage dans des opérations de rachat, de prise en pension et/ou de rachat d'actions à l'avenir, le Prospectus sera modifié afin de fournir les informations requises conformément aux lois et règlements applicables.

2) Techniques et instruments de protection contre les risques de change

Afin de se protéger contre les fluctuations de change, un Compartiment peut effectuer des transactions sur des contrats à terme standardisés sur instruments financiers (contrats de futures), bons de souscription (warrants) et options négociés sur un Marché réglementé.

Un Compartiment peut également effectuer des transactions sur des options, swaps et contrats à terme (forward) conclus de gré à gré avec des institutions financières réglementées dont le siège social est sis dans un État membre de l'OCDE, spécialisées dans ce type de transactions, bénéficiant au minimum d'une notation « investment grade » et soumises à une surveillance prudentielle (par exemple, des établissements de crédit ou des sociétés d'investissement).

Afin de se protéger contre le risque de change, un Compartiment peut nouer des engagements sur des contrats de change à terme standardisés et/ou vendre des options d'achat, acheter des options de vente ou effectuer des transactions sur des bons de souscription (warrants) portant sur des devises, ou conclure des contrats de change à terme de gré à gré ou des swaps de devises. L'objectif de couverture des opérations auxquelles il est fait référence ci-dessus présume l'existence d'une relation directe entre les opérations envisagées et les éléments d'actif ou de passif à couvrir et implique que, en

principe, les transactions sur une monnaie donnée ne doivent pas excéder l'évaluation du total des actifs libellés dans cette monnaie et, s'agissant de leur durée, ne doivent pas avoir une durée supérieure à la durée de détention de ces actifs.

3) Autres instruments

(a) Warrants

Les bons de souscription seront considérés comme des titres négociables s'ils confèrent à l'investisseur le droit d'acquérir des titres négociables récemment émis ou à émettre. Toutefois, un Compartiment ne peut investir dans des bons de souscription s'ils ont pour actif sous-jacent de l'or, du pétrole ou d'autres matières premières.

Les Compartiments peuvent investir dans des bons de souscription basés sur des indices boursiers aux fins d'une gestion de portefeuille efficiente.

(b) Titres relevant de la Rule 144 A

Un Compartiment peut investir dans des titres relevant de la Règle 144A, lesquels sont des titres destinés à être revendus et qui n'ont pas besoin d'être enregistrés aux États-Unis conformément à l'exemption prévue à la Section 144A de la Loi de 1933 (« Titres régis par la Règle 144A »), mais qui peuvent être vendus à certains investisseurs institutionnels aux États-Unis. Un Compartiment peut investir dans des Titres Règle 144A sous réserve que : lorsqu'ils sont émis, ces titres soient assortis de droits d'enregistrement en vertu desquels ils peuvent être enregistrés selon la Loi de 1933 et négociés sur le marché de gré à gré des titres à taux fixe aux États-Unis. Ces titres seront considérés comme des valeurs mobilières récemment émises.

Dans le cas où des titres de cette nature ne seraient pas enregistrés en vertu de la Loi de 1933 dans un délai d'un an après leur émission, ils seront considérés comme étant soumis à la limite de 10 % de l'actif net du Compartiment qui s'applique à la catégorie des titres non cotés.

(c) Obligations structurées

Sous réserve de toutes limites imparties par son objectif et sa politique d'investissement et des Restrictions sur les investissements qui sont décrites plus haut, tout Compartiment peut investir dans des obligations structurées comprenant des obligations d'État cotées en Bourse et des obligations à moyen terme, certificats ou autres instruments similaires provenant d'émetteurs très bien notés si leur coupon et/ou valeur de remboursement respectif a été modifié (ou structuré) au moyen d'un instrument financier.

Les Restrictions sur les investissements s'appliquent à l'émetteur de l'obligation structurée ainsi qu'à son actif sous-jacent.

Ces obligations sont évaluées par des courtiers en se référant à la valeur actualisée et révisée des flux de trésorerie futurs des actifs sous-jacents.

POLITIQUE DE GARANTIES

Dans le cadre du recours à opérations sur instruments financiers de gré à gré ou à des techniques de gestion efficace de portefeuille, la Société peut recevoir des garanties en vue de réduire son risque de contrepartie. La présente section énonce la politique en matière de garantie appliquée à cet égard par la Société. Tous les actifs reçus par la Société dans ce cadre doivent être considérés comme des garanties aux fins de la présente section.

Dans le cadre décrit ci-dessus, toutes les garanties éligibles décrites ci-après sont la propriété du Compartiment concerné. Elles sont portées sur le compte de titres du Compartiment concerné tenu par son Dépositaire.

Garanties éligibles :

Les garanties reçues par la Société peuvent être utilisées pour réduire son exposition au risque de contrepartie si elles répondent aux critères spécifiés dans les lois, réglementations et circulaires applicables occasionnellement émises par l'Autorité de Surveillance du Luxembourg, notamment en termes de liquidité, d'évaluation, de qualité de crédit de l'émetteur, de corrélation, de risques liés à la gestion des garanties et d'applicabilité. En particulier, les garanties doivent respecter les conditions suivantes :

- (a) toute garantie reçue sous une forme autre que numéraire doit être de grande qualité, extrêmement liquide et négociée sur un marché réglementé ou un système multilatéral de négociation appliquant des prix transparents de façon à pouvoir être vendue rapidement à un prix proche de son évaluation avant la vente.
- (b) elle doit être évaluée au moins une fois par jour et les actifs affichant une forte volatilité en termes de prix ne doivent pas être acceptés en garantie à moins que des décotes prudentes ne soient pratiquées ;
- (c) elle doit être émise par une entité qui est indépendante de la contrepartie et ne devrait pas présenter une forte corrélation avec la performance de la contrepartie ;
- (d) elle doit être suffisamment diversifiée en termes de pays, de marchés et d'émetteurs, avec une exposition maximale de 20 % de la Valeur liquidative du Compartiment à tout émetteur unique ou globalement, en tenant compte de toutes les garanties reçues.

- (e) elle doit pouvoir être entièrement mise en œuvre par la Société, à tout moment, sans qu'il soit nécessaire de consulter la contrepartie ou d'obtenir son accord.
- (f) en cas de transfert de propriété, les garanties reçues doivent être conservées par le Dépositaire ou l'un de ses sous-dépositaires auquel le Dépositaire a délégué la garde de la garantie en question. S'agissant d'autres types de contrats de garantie (par exemple, un nantissement), les garanties peuvent être conservées par un dépositaire tiers soumis à une surveillance prudentielle et ne possédant aucun lien avec le fournisseur des garanties.

Nonobstant la condition précisée au point (d) ci-dessus, le Compartiment peut accepter des garanties qui accroissent son exposition à un même émetteur à plus de 20 % de sa valeur liquidative à condition que :

- ces garanties soient émises par (i) un État membre, (ii) une ou plusieurs de ses collectivités locales, (iii) un pays tiers, ou (iv) un organisme public international auquel un ou plusieurs États membres adhèrent, et que ;

- ces garanties proviennent d'au moins six émissions différentes, étant précisé qu'aucune émission ne représentera plus de 30 % de l'actif net du Compartiment.

La Société a instauré une Politique d'éligibilité qui définit les critères d'éligibilité supplémentaires suivants :

- pour les actions reçues en garantie, la Société en apprécie l'éligibilité à l'aune du volume moyen de transaction quotidienne et de seuils de capitalisation boursière. La Société a également défini une liste de pays émetteurs éligibles pour les actions reçues en garantie.
- pour les obligations reçues en garantie, la politique d'éligibilité repose sur la notation du risque de crédit émise par l'une des principales agences de notation, l'échéance, le rang de la dette et un seuil minimal d'obligations en circulation. La Société a également défini une liste de pays émetteurs éligibles pour les obligations reçues en garantie, en fonction du type d'obligations considérées.

Sous réserve des conditions susmentionnées, les garanties reçues par la Société peuvent consister en ce qui suit :

- (i) espèces et quasi-espèces, y compris des certificats bancaires à court terme et des instruments du marché monétaire ;
- (ii) obligations émises ou garanties par un État membre de l'OCDE, par ses autorités

publiques locales, par des institutions et entreprises supranationales disposant d'une couverture européenne (UE), régionale ou mondiale, ou par tout pays dans la mesure où les conditions (a) à (e) ci-dessus sont entièrement satisfaites ;

- (iii) actions, parts ou unités émises par des OPC monétaires valorisées quotidiennement et bénéficiant d'une notation AAA ou son équivalent ;
- (iv) actions, parts ou unités émises par des OPCVM investissant principalement dans des obligations/actions visées aux alinéas (v) et (vi) ci-dessous ;
- (v) obligations émises ou garanties par des émetteurs de premier rang offrant une liquidité adéquate ;
- (vi) valeurs admises ou négociées sur un marché réglementé d'un État membre de l'UE ou une bourse d'un État membre de l'OCDE ou de tout pays dans la mesure où les conditions (a) à (e) ci-dessus sont entièrement satisfaites, et à condition que ces valeurs soient incluses dans un indice principal.

Niveau et évaluation de la garantie

La Société déterminera le niveau de garantie requis pour les transactions de Swaps financés en se référant aux limites du risque de contrepartie spécifiées dans le présent Prospectus et en tenant compte de la nature et des caractéristiques des transactions, de la solvabilité et de l'identité des contreparties et des conditions de marché.

Les titres acquis par le Compartiment en garantie de Swap financé doivent être émis par une entité qui est indépendante de la contrepartie et ne devrait pas présenter une forte corrélation avec la performance de la contrepartie.

Politique en matière de décotes

La garantie sera évaluée quotidiennement, en utilisant les prix de marché disponibles et en prenant compte les escomptes appropriées qui seront déterminées pour chaque classe d'actifs en fonction de la politique en matière de décotes de la Société de gestion.

Cette décote sera déterminée par la Société de gestion en fonction des critères suivants, entres autres :

- (a) la nature du titre ;
- (b) l'échéance du titre (le cas échéant) ;
- (c) la notation de l'émetteur du titre (le cas échéant).

La Société de gestion prévoit que les pourcentages d'escompte indiqués dans le tableau ci-après seront utilisés pour le calcul de

la valeur de la garantie reçue par le Compartiment (la Société de gestion se réserve le droit de modifier cette politique à tout moment, auquel cas le présent Prospectus sera mis à jour en conséquence) :

Type d'actif reçu en garantie	Marge
(i)	100 % - 102 %
(ii)	100 % - 110 %
(iii)	100 % - 102 %
(iv)	100 % - 135 %
(v)	100 % - 115 %
(vi)	100 % - 135 %

Les types de garanties libellés dans une devise autre que la devise du Compartiment peuvent être soumis à une décote supplémentaire.

Réinvestissement de garanties

Les garanties autres qu'en numéraire reçues par la Société ne peuvent pas être vendues, réinvesties ou nanties.

Les garanties en numéraire reçues par la Société peuvent uniquement être :

- i. déposées auprès d'établissements de crédit ayant leur siège social dans un État membre de l'UE ou, si leur siège social est situé dans un pays tiers, qui sont soumis à des règles prudentielles jugées équivalentes par l'Autorité de Surveillance du Luxembourg à celles prescrites dans le droit de l'Union européenne ;
- ii. investies dans des obligations d'État de haute qualité ;
- iii. utilisées aux fins d'opérations de prise en pension pour autant que ces opérations soient conclues avec des établissements de crédit soumis à un contrôle prudentiel et que la Société soit en mesure de récupérer à tout moment le montant intégral des liquidités sur une base prorata temporis ; et/ou
- iv. investies dans des fonds du marché monétaire à court terme tels que définis dans la Proposition de définition commune des fonds monétaires européens.

Les garanties en numéraire réinvesties doivent être diversifiées conformément aux prescriptions de diversification applicables aux garanties autres qu'en numéraire, comme indiqué ci-avant.

Le Compartiment peut essuyer des pertes en réinvestissant les garanties en numéraire qu'il reçoit. Ces pertes peuvent résulter d'une baisse de la valeur des investissements réalisés avec les garanties en numéraire reçues. Une diminution de la valeur de ces investissements peut réduire le montant des garanties disponibles

à restituer à la contrepartie par le Compartiment lors de la conclusion de la transaction. Le Compartiment peut être tenu de couvrir la différence de valeur entre les garanties initialement reçues et le montant disponible à restituer à la contrepartie, entraînant une perte pour le Compartiment.

Processus de gestion des risques

La Société appliquera une procédure de gestion des risques lui permettant de mesurer et suivre à tout instant le risque de ses positions et leur contribution au profil de risque global de chaque Compartiment. La Société utilisera, le cas échéant, un processus d'évaluation précise et indépendante concernant la valeur de tout instrument dérivé de gré à gré.

Il existe trois approches possibles de mesure des risques (par les engagements, valeur à risque absolue, valeur à risque relative). La Société de Gestion décide de l'approche applicable à chaque Compartiment.

Sauf indication contraire dans l'Annexe du Compartiment concerné, l'exposition globale des Compartiments est calculée selon la méthode des engagements telle qu'elle est décrite en détail dans la législation et la réglementation en vigueur, y compris, de façon non limitative, la Circulaire 11/512 de la CSSF.

II/ Valeur liquidative

CALCUL DE LA VALEUR LIQUIDATIVE PAR ACTION

La valeur liquidative par action (ci-après la « **Valeur liquidative par action** ») de chaque Catégorie d'un Compartiment sera calculée par l'Agent administratif dans la monnaie de référence (ci-après la « **Monnaie de référence** ») ou « **Devise de référence** ») du Compartiment et de la Catégorie concernés.

La Valeur liquidative par action est calculée chaque Jour de valorisation tel qu'il est défini en Annexe H (*Glossaire*), et au minimum deux fois par mois. La Valeur liquidative par action de tous les Compartiments sera déterminée sur la base des derniers cours de clôture ou autres prix de référence tels qu'ils sont spécifiés dans les Annexes qui les concernent. Si les cotations sur les marchés où est négociée ou cotée une part notable des investissements imputables à un Compartiment donné ont subi un changement notable depuis la clôture de ces marchés, la Société, afin de sauvegarder ses propres intérêts comme ceux des actionnaires, peut annuler l'évaluation initiale et procéder à une nouvelle évaluation avec prudence et de bonne foi.

La Valeur liquidative par action de chaque Catégorie d'actions d'un Compartiment est déterminée en divisant la valeur de l'actif total de ce Compartiment qui revient à cette Catégorie d'actions, après déduction du passif de ce même

Compartiment qui revient à ladite Catégorie d'actions, par le nombre total d'Actions de cette Catégorie qui sont en circulation à une Date de valorisation donnée.

La Valeur liquidative des différentes Catégories d'actions d'un Compartiment peut ne pas être identique en raison de la politique de distribution de dividendes, de la commission de gestion et des commissions de souscription et de rachat applicables à chaque Catégorie. Pour calculer la Valeur liquidative par Action, les produits et charges sont comptabilisés quotidiennement.

Le calcul de la Valeur liquidative par Action des diverses Catégories d'actions sera effectué selon les modalités ci-après :

a) L'actif de la Société est réputé inclure :

- la totalité des disponibilités et dépôts, y compris tous intérêts courus ;
- la totalité des billets et effets à vue et des comptes clients (y compris le produit des titres vendus, mais non encore livrés) ;
- la totalité des obligations, certificats de dépôt, actions, obligations non garanties, unités, parts ou actions d'organismes de placement collectif, droits de souscription, bons de souscription, options et autres titres, instruments financiers et actifs similaires appartenant à la Société ou pour lesquels elle a conclu des contrats (sous réserve que la Société puisse procéder à des ajustements selon des modalités qui ne soient pas incompatibles avec le paragraphe (i) ci-dessous en ce qui concerne les fluctuations de la valeur vénale des titres qui sont dues au détachement de coupons de dividendes ou de droits ou à des pratiques similaires) ;
- la totalité des dividendes en actions et en espèces et des distributions d'espèces que la Société doit recevoir dans la mesure où elle dispose à ce sujet d'informations dont elle a raisonnablement lieu de croire qu'elles sont suffisantes ;
- la totalité des intérêts courus sur tous actifs portant intérêt qui appartiennent à la Société, sauf dans la mesure où ces intérêts sont inclus dans le principal de ces actifs ou dans laquelle le principal de ces actifs en tient compte ;
- les frais d'établissement de la Société dans la mesure où ils n'ont pas été passés en charges ;
- la totalité des autres actifs, de quelque sorte et nature que ce soit, y compris les charges payées d'avance.

La valeur de ces actifs sera déterminée comme suit :

- La valeur des disponibilités, dépôts, billets, effets à vue et comptes clients, charges payées d'avance, dividendes en espèces et intérêts déclarés ou courus et qui n'ont pas encore été encaissés sera réputée être égale à la totalité de leur montant, sauf s'il est douteux que l'intégralité de ce montant soit payée ou reçue, auquel cas leur valeur sera déterminée en appliquant l'abattement qui sera jugé approprié en l'espèce pour refléter leur véritable valeur ;
- les titres cotés sur une Bourse de valeurs reconnue ou négociés sur tout autre marché réglementé (désigné ci-après « Marché réglementé ») qui fonctionne régulièrement et est reconnu et ouvert au public sont évalués au dernier cours de clôture disponible ou, dans le cas où il existe plusieurs marchés de cette sorte, sur la base du dernier cours de clôture observé sur le marché principal de ces titres ;
- Dans le cas où, aux yeux du conseil d'administration, le dernier cours de clôture disponible ne reflète pas fidèlement la juste valeur de marché de certains titres, la valeur de ceux-ci sera fixée par le conseil d'administration en se fondant sur le produit de leur cession prévu, lequel sera déterminé avec prudence et de bonne foi ;
- les titres qui ne sont pas cotés sur une Bourse de valeurs ou négociés sur un autre marché réglementé seront évalués sur la base du produit probable de leur cession, lequel sera déterminé avec prudence et de bonne foi par le Conseil d'administration ;
- la valeur des instruments dérivés financiers qui sont négociés sur des Bourses ou sur un autre Marché réglementé sera égale au dernier cours de compensation disponible pour ces instruments dérivés financiers sur les Bourses ou Marchés réglementés sur lesquels ces contrats sont négociés par la Société, sous réserve que si les contrats dérivés financiers n'ont pu être liquidés le jour pour lequel l'actif net est calculé, la base sur laquelle sera déterminée la valeur de ces instruments dérivés financiers soit égale à la valeur que le Conseil d'administration jugera juste et raisonnable ;
- les instruments dérivés financiers qui ne sont pas cotés sur une Bourse officielle ou négociés sur un autre marché réglementé seront évalués de manière fiable et vérifiable sur une base quotidienne et vérifiés par un professionnel désigné par la Société ;
- les investissements dans des OPCVM seront évalués sur la base de la dernière valeur liquidative connue des

- unités, parts ou actions de ces OPCVM ;
- Et tous les autres titres négociables et autres actifs autorisés seront évalués à leur juste valeur de marché déterminée de bonne foi conformément aux procédures instaurées par le Conseil d'administration.
 - les actifs liquides et les instruments du marché monétaire seront évalués à la valeur du marché majorée des intérêts éventuels ou au coût amorti en fonction des procédures instaurées par le Conseil d'administration. Tous les autres actifs, si autorisés dans la pratique, pourront être évalués de la même manière. Si l'on emploie la méthode d'évaluation à la fraction non amortie du coût, les lignes du portefeuille seront examinées de temps à autre sous la direction du Conseil d'administration afin de déterminer s'il existe un écart entre la Valeur liquidative calculée selon cette méthode et celle qui est calculée à partir des cotations de marché. S'il apparaît un écart susceptible d'entraîner une dilution importante ou un autre résultat lésant les investisseurs ou les actionnaires actuels, des mesures appropriées seront prises pour y remédier, notamment, si nécessaire, le calcul de la Valeur liquidative au moyen des cotations de marché disponibles.
 - si les méthodes de calcul susmentionnées sont inapplicables ou trompeuses, le Conseil d'administration pourra ajuster la valeur d'un investissement ou permettre l'utilisation d'autres méthodes d'évaluation pour les actifs de la Société s'il considère que les circonstances justifient cette démarche et que l'ajustement ou d'autres méthodes d'évaluation doivent être adoptées pour mieux refléter la valeur de ces investissements.

Tout actif qui n'est pas libellé dans la Monnaie de référence de la Société sera converti dans ladite Monnaie de référence au taux de change en vigueur sur un marché reconnu le jour précédant le Jour de valorisation concerné.

Tout actif d'un Compartiment donné qui n'est pas libellé dans la Devise de référence de ce Compartiment sera converti dans ladite Devise de référence au taux de change en vigueur sur un marché reconnu le Jour de négociation précédant le Jour de Valorisation (tel qu'il est défini dans l'Annexe H, *Glossaire*). La même règle s'appliquera mutatis mutandis aux Catégories d'actions.

Le Conseil d'administration peut à sa discrétion, autoriser l'emploi de toute autre méthode d'évaluation reposant sur le prix de vente probable déterminée avec

prudence et de bonne foi par le Conseil d'administration s'il considère qu'une telle évaluation rend compte plus fidèlement de la juste valeur de tout actif de la Société.

Dans le cas où les cotations de certains actifs détenus par la Société ne seraient pas disponibles pour le calcul de la Valeur liquidative par action d'un Compartiment, chacune de ces cotations pourra être remplacée, selon ce que décidera le Conseil d'administration, soit par la dernière cotation connue (sous réserve que cette dernière cotation soit également représentative) précédant la dernière cotation, soit par la dernière évaluation de la dernière cotation au Jour de valorisation concerné.

b) Le passif de la Société est réputé inclure :

- i) la totalité des prêts, effets et comptes fournisseurs ;
- ii) la totalité des frais administratifs courus ou exigibles qui sont dus par la Société ;
- iii) tous les passifs connus, présents et futurs, notamment toutes les obligations contractuelles arrivées à échéance, couvrant des paiements en espèces ou en nature ;
- iv) une provision suffisante pour couvrir les impôts futurs assis sur le capital et les revenus qui sont dus jusqu'au Jour de négociation précédant le Jour de valorisation tels qu'ils pourront être déterminés de temps à autre par la Société, et les autres provisions et réserves qui, le cas échéant, ont été autorisées et approuvées par le Conseil d'administration, en particulier celles qui ont été constituées pour faire face à une éventuelle dépréciation des investissements de la Société ; et
- v) tous les autres passifs de la Société de quelque sorte et nature que ce soit, à l'exception des passifs représentés par des actions de la Société. Pour déterminer le montant de ce passif, la Société prendra en compte toutes les dépenses dues par la Société.

Toutes les Actions dont le rachat par la Société est en cours seront réputées être émises jusqu'à la fermeture des bureaux le Jour de valorisation applicable à leur rachat. Le prix de rachat est un engagement de la Société depuis la clôture du jour d'évaluation jusqu'au paiement.

Toutes les actions émises par la Société en accord avec les demandes de souscription reçues seront censées être émises depuis la clôture de la journée au Jour d'évaluation applicable à la souscription. Le prix de souscription est une créance de la Société de la fermeture des bureaux à cette date jusqu'à son paiement.

L'actif net de la Société est exprimé en euros ; il est en permanence égal au montant total de l'actif net des divers Compartiments.

SUSPENSION TEMPORAIRE DU CALCUL DE LA VALEUR LIQUIDATIVE PAR ACTION

La Société a la faculté de suspendre le calcul de la Valeur liquidative d'un ou plusieurs Compartiments et l'émission, le rachat et la conversion des Catégories d'Actions dans les circonstances ci-après :

- (a) durant toute période où l'une des quelconques principales bourses de valeurs ou autres marchés sur lesquels une partie substantielle des investissements de la Société attribuables à un tel Compartiment est cotée ou négociée est fermée pour d'autres raisons que les vacances habituelles, ou lorsque les transactions sont suspendues ou restreintes ;
- (b) durant l'existence d'un quelconque état de fait qui, dans l'opinion des Administrateurs, constitue une urgence résultant de l'impossibilité de disposer ou d'évaluer les actifs appartenant à la Société et attribuables à un Compartiment ;
- (c) durant une rupture ou une restriction des moyens de communication habituellement utilisés pour la détermination du prix ou de la valeur des investissements du Compartiment ou du prix actuel ou de la valeur sur n'importe quelle bourse de valeurs officielle ou autre marché au regard des actifs attribuables à ce Compartiment ;
- (d) durant toute période où la Société est dans l'impossibilité de rapatrier les fonds nécessaires pour effectuer les paiements relatifs aux demandes de rachat d'Actions d'un Compartiment concerné ou durant laquelle aucun transfert de fonds impliqué dans la réalisation ou l'acquisition des investissements ou paiements dus sur le rachat des Actions, ne peut, dans l'opinion des Administrateurs, être effectué selon des taux de change normaux ;
- (e) pendant toute période au cours de laquelle, aux yeux des Administrateurs de la Société, il existe des circonstances inhabituelles du fait desquelles il serait irréaliste ou injuste, vis-à-vis des Actionnaires, de continuer à négocier les Actions de tout Compartiment de la Société, ou toute autre circonstance à cause de laquelle le fait de ne pas agir ainsi pourrait avoir pour effet de mettre une quelconque dette fiscale à la charge des Actionnaires de la Société, d'un Compartiment ou d'une Catégorie d'Actions, ou de leur faire subir un quelconque autre désavantage pécuniaire ou autre préjudice que, autrement, les Actionnaires de la Société, du Compartiment ou de la Catégorie d'Actions en question ne subiraient pas ;
- (f) dans le cas de (i) la publication de l'avis de convocation à une assemblée générale des Actionnaires à laquelle une résolution sur la dissolution de la Société ou d'un Compartiment doit être proposée, ou de (ii) la décision du Conseil d'administration de dissoudre un ou plusieurs Compartiments, ou (iii) dans la mesure où cette suspension est justifiée par le souci de protéger les Actionnaires du fait de l'avis de convocation de l'assemblée générale des Actionnaires à laquelle la fusion de la Société ou d'un Compartiment doit être proposée, ou dans le cas de la décision du Conseil d'administration de fusionner un ou plusieurs Compartiments ;
- (g) si, pour toute autre raison indépendante de la volonté du Conseil d'administration, le prix de tous investissements appartenant à la Société et imputables à ce compartiment ne peut être établi promptement ou avec exactitude ;
- (h) si un OPCVM dans lequel un Compartiment a investi une part substantielle de ses actifs suspend temporairement le calcul de la Valeur liquidative de ses actions/parts, le rachat, le remboursement ou la souscription de ses actions/parts, de sa propre initiative ou à la demande de ses autorités compétentes ;
- (i) après la suspension du calcul de la valeur liquidative par action/titre, le rachat et/ou la conversion des actions/parts, au niveau d'un fonds maître dans lequel un Compartiment investit en sa qualité de fonds nourricier de ce fonds maître.

La suspension du calcul de la Valeur liquidative d'un Compartiment sera sans effet sur le calcul de la Valeur liquidative par action, l'émission, le rachat et la conversion d'Actions de tout autre Compartiment qui n'est pas suspendu.

Toute suspension sera dûment notifiée aux Actionnaires demandant le rachat ou la conversion de leurs Actions par la Société au moment du dépôt de la demande écrite de rachat. Le Conseil d'administration pourra également rendre publique cette suspension de la manière qu'il juge la plus appropriée.

Les demandes de souscription, rachat et conversion suspendues pourront être retirées par avis écrit sous réserve que la Société reçoive cette notification avant la fin de la suspension.

Les demandes de souscription, rachat et conversion suspendues seront exécutées au premier Jour de valorisation suivant la reprise du calcul de la valeur liquidative par la Société.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE PAR ACTION

La Valeur liquidative par Action de chaque Catégorie d'actions d'un Compartiment est publiée et peut être obtenue au siège de la Société et dans les bureaux du Dépositaire. La Société est libre de publier cette information dans des journaux financiers de premier plan. La Société décline toute responsabilité pour tout retard ou erreur affectant la publication des cours et pour le fait qu'ils ne soient pas publiés.

III/ Caractéristiques des Actions

LES ACTIONS (ÉMISSION ET FORME)

Les Actions seront émises à la Valeur liquidative par action de la Catégorie concernée (le « **Prix d'émission** ») à l'issue de la période de souscription initiale telle qu'elle est définie dans l'Annexe correspondante. Des fractions d'Actions seront émises selon les modalités fixées pour chaque Catégorie et Compartiment dans l'Annexe qui le concerne, et la Société aura le droit de garder la différence d'arrondi.

Les actions seront uniquement émises sous forme nominative. Le registre des Actionnaires a valeur concluante pour prouver la propriété des actions. La Société considère le propriétaire inscrit d'une action comme son bénéficiaire absolu et effectif.

Les actions nominatives ne donnent pas lieu à l'émission d'un certificat et seront matérialisées par une inscription dans le registre des Actionnaires, sauf si un certificat d'action (le « **Certificat d'Action** ») est expressément demandé au moment de la souscription. Tous les frais liés à l'émission d'un Certificat d'Action seront à la charge de l'investisseur. Ces Certificats ne seront émis que sous la forme de coupures de 1, 10 et 100 actions. Si un investisseur demande des Certificats d'Actions, ceux-ci seront, en principe, délivrés au Luxembourg dans un délai de quinze jours civils à partir du paiement du prix d'achat.

Les détenteurs de Certificats d'Actions doivent les retourner dûment endossés à la Société pour que leur ordre de rachat puisse être exécuté. Le fait que les Actions soient dématérialisées permet à la Société d'exécuter les ordres de rachat dans un délai raisonnable ; c'est pourquoi le Conseil d'administration recommande aux investisseurs de ne pas demander l'établissement de Certificats d'Actions.

Les Actions sont librement cessibles (à cette exception près qu'elles ne peuvent être cédées à une personne qui n'est pas un Détenteur qualifié, tel que défini dans le paragraphe intitulé « Procédure de souscription »).

Aucun droit préférentiel ou de préemption n'est attaché aux Actions et chacune d'entre elles, quelles que soient sa Valeur liquidative et la Catégorie à laquelle elle appartient, confère une voix à toutes les assemblées générales des actionnaires. Les fractions d'Actions n'ont pas de droit de vote, mais bénéficient de la performance des Actions concernées calculée au prorata ainsi que des distributions de dividendes et du produit de la liquidation de la Société au moment de sa liquidation. Les Actions sont émises sans valeur faciale et doivent être entièrement libérées à la souscription.

Au décès d'un Actionnaire, le Conseil d'administration se réserve le droit d'exiger la remise des documents juridiques appropriés pour vérifier les droits de tous les ayants droits sur les Actions.

Aucune Action de quelque Catégorie que ce soit ne sera émise par la Société pendant une quelconque période au cours de laquelle le calcul de la Valeur liquidative par action est suspendu par la Société, comme indiqué dans la section intitulée « Suspension du calcul de la Valeur liquidative par action ».

CATÉGORIES D' ACTIONS

La Société a la faculté de créer, pour chaque Compartiment, différentes Catégories d'actions ouvrant droit au paiement de dividendes ordinaires (« **Actions de Distribution** ») ou pour lesquelles les bénéfices sont réinvestis (« **Actions de Capitalisation** »), mais qui diffèrent aussi en fonction des investisseurs visés, de la devise de référence, de la politique de couverture de change et du taux des commissions de gestion, de souscription ou de rachat.

Actions de Catégorie « **C** » : Catégorie d'actions de capitalisation destinée à tous les investisseurs, cotée sur au moins une bourse (se reporter au Chapitre V – Marché secondaire des ETF ayant le statut d'OPCVM) et qui peut être libellée dans différentes devises.

Actions de Catégorie « **D** » : Catégorie d'actions de distribution destinée à tous les investisseurs, cotée sur au moins une bourse (se reporter au Chapitre V – Marché secondaire des ETF ayant le statut d'OPCVM) et qui peut être libellée dans différentes devises.

Actions de la Catégorie « **Dist** » : Catégorie d'actions de distribution destinée à tous les investisseurs, libellée dans la devise du Compartiment ou dans une autre devise, comme indiqué dans l'annexe du Compartiment concerné, et libellée dans différentes devises.

selon la bourse considérée (se reporter au Chapitre V – Marché secondaire des ETF ayant le statut d'OPCVM).

Actions de la Catégorie « **Acc** » : Catégorie d'actions de capitalisation destinée à tous les investisseurs, libellée dans la devise du Compartiment ou dans une autre devise, comme indiqué dans l'annexe du Compartiment concerné, et libellée dans différentes devises selon la bourse considérée (se reporter au Chapitre V – Marché secondaire des ETF ayant le statut d'OPCVM).

Actions de Catégorie « **CI** » : Catégorie d'actions de capitalisation destinée aux Investisseurs institutionnels au sens de l'article 174 (2) c) de la Loi de 2010, qui peut être libellée dans différentes devises et qui n'est pas cotée sur une bourse de valeurs.

Actions de Catégorie « **DI** » : Catégorie d'actions de distribution destinée aux Investisseurs institutionnels au sens de l'article 174 (2) c) de la Loi de 2010, qui peut être libellée dans différentes devises et qui n'est pas cotée sur une bourse de valeurs.

Actions de Catégorie « **S-Acc** » : Catégorie d'actions de capitalisation destinée aux Investisseurs institutionnels au sens de l'article 174 (2) c) de la Loi de 2010, qui peut être libellée dans différentes devises.

Actions de Catégorie « **S-Dist** » : Catégorie d'actions de distribution destinée aux Investisseurs institutionnels au sens de l'article 174 (2) c) de la Loi de 2010, qui peut être libellée dans différentes devises.

Les sommes investies dans les Catégories d'actions d'un Compartiment donné sont elles-mêmes réinvesties dans un portefeuille commun d'investissements sous-jacents à ce Compartiment, bien que la Valeur liquidative par action de chaque Catégorie d'actions puisse différer à cause de la politique de distribution et/ou de la Commission de gestion et/ou de la Commission administrative (tels qu'ils sont définis ci-après) et/ou des commissions de souscription et de rachat applicables à chaque Catégorie.

Pour tous renseignements supplémentaires sur les Catégories d'actions, les investisseurs doivent se reporter à l'Annexe consacrée au Compartiment concerné.

IV/ Investir dans la Société sur le marché primaire

Le marché primaire est le marché sur lequel des Actions sont émises et/ou rachetées aux Participants autorisés par la Société sous réserve des conditions et modalités spécifiées ci-après et dans les Annexes concernées (le « **Marché primaire** »).

Le Marché primaire des Actions des Compartiments qui ont la dénomination d'ETF ayant le statut d'OPCVM (UCITS ETF) est essentiellement réservé aux Participants autorisés de ces ETF.

La Société de gestion a conclu des accords avec les Participants autorisés aux fins de déterminer les conditions dans lesquelles ceux-ci peuvent souscrire des Actions et en demander le rachat.

Un Participant autorisé peut soumettre une demande de souscription ou de rachat des Actions d'un Compartiment par le biais d'une plateforme électronique de saisie d'ordres en ligne ou en appelant des lignes spécialisées permettant de passer des ordres en dehors de toute plateforme de ce type. Dans les deux cas, le Participant autorisé devra soumettre un Formulaire de transaction. L'Heure limite d'acceptation des demandes reçues un Jour de négociation est fixée à 17 h 00 (heure de Luxembourg) le jour même, sauf indication contraire dans l'Annexe D – *Tableau récapitulatif du calendrier de négociation des Compartiments*.

L'utilisation de la plateforme électronique est soumise à l'approbation préalable de la Société de gestion, ou, le cas échéant, le Gestionnaire de placements, et doit être conforme à la loi applicable. Les ordres de souscription et de rachat placés par voie électronique peuvent être soumis à une Heure limite de négociation spécifique.

Des Formulaires de transaction sont disponibles auprès de la Société de gestion et de l'Agent comptable des registres et Agent des transferts.

Toutes les demandes sont effectuées aux seuls risques du Participant autorisé. Les Formulaires de demande et les demandes de traitement électroniques, une fois acceptés, sont irrévocables (sauf décision contraire de la Société de gestion ou, le cas échéant, le Gestionnaire de placements). La Société, Amundi, la Société de gestion, le Gestionnaire de placements et l'Agent comptable des registres et Agent des transferts ne pourront être tenus responsables des éventuelles pertes découlant de la transmission des Formulaires de demande ou de toute perte découlant de la transmission de toute demande via le système électronique d'enregistrement des ordres.

Les demandes de souscription/rachat d'Actions reçues par l'Agent comptable des registres et Agent des transferts avant l'Heure limite de négociation (telle que définie dans l'Annexe H, *Glossaire*) au cours d'un Jour de négociation (tel que défini dans l'Annexe D, *Tableau récapitulatif du calendrier de négociation des compartiments*) seront exécutées ce même jour en appliquant la Valeur liquidative par action (telle que définie dans l'Annexe H, *Glossaire*) calculée le Jour de valorisation correspondant. Cette Valeur liquidative reposera sur les derniers cours de clôture disponibles ou autres prix de référence

selon les modalités décrites dans les Annexes concernées.

Toutes les demandes de souscription/rachat seront exécutées à une Valeur liquidative inconnue (« fixation des prix à terme »).

Toute demande de souscription/rachat reçue après l'Heure limite de négociation le Jour de négociation concerné sera exécutée le Jour de négociation suivant, sur la base de la Valeur liquidative par action arrêtée au Jour de valorisation correspondant.

Les délais applicables peuvent différer selon que des Actions sont souscrites par le biais d'un Distributeur/Mandataire, mais dans tous les cas, ce Distributeur/Mandataire veillera à ce que, au cours d'un Jour de négociation donné (tel que défini dans l'Annexe H, *Glossaire*), les demandes de souscription soient reçues par l'Agent comptable des registres et Agent des transferts avant l'Heure limite de négociation. Aucun Distributeur/Mandataire n'est autorisé à différer des ordres de souscription pour tirer un profit personnel d'une variation de prix. L'attention des investisseurs est attirée sur le fait qu'il peut être impossible d'acheter des Actions ou d'en demander le rachat par le biais d'un Distributeur/Mandataire les jours où ce dernier est fermé.

Les souscriptions d'Actions ne peuvent être acceptées que sur la base de la version la plus récente du Prospectus et de chaque DIC pertinent. La Société produira un Rapport annuel (le « **Rapport annuel** ») contenant les comptes audités et un Rapport semestriel non audité (le « **Rapport semestriel** »). Après la publication du premier de l'un ou l'autre de ces rapports, la version actuelle du Prospectus à cette date ne sera valide que si elle est accompagnée de ce Rapport annuel ou, s'il est plus récent, de ce Rapport semestriel. Ces rapports, dans leur version la plus récente, feront partie intégrante du Prospectus.

Refus de souscriptions/rachats

La Société est libre de rejeter toute souscription en tout ou partie et le Conseil d'administration a la faculté, à tout instant, de temps à autre et à son entière discrétion, et sans que sa responsabilité soit engagée et sans préavis, de mettre fin à l'émission et la vente d'Actions d'une quelconque Catégorie d'un quelconque Compartiment.

La Société peut également, à son entière discrétion (mais sans y être tenue), rejeter ou annuler en tout ou en partie toute souscription d'Actions avant l'émission d'Actions à destination d'un Participant autorisé si ce dernier est soumis à une Procédure d'insolvabilité et/ou pour réduire son exposition au risque d'insolvabilité du Participant autorisé.

Ajustements de souscriptions/rachats

La Société a également le droit de déterminer si elle acceptera uniquement des rachats d'un Participant autorisé, en nature ou en numéraire (ou les deux), au cas par cas : (i) sur notification au Participant autorisé, si celui-ci devient insolvable, ou si la Société a des motifs raisonnables de croire que le Participant autorisé concerné représente un risque de crédit, ou (ii) dans tous les autres cas, avec le consentement du Participant autorisé concerné (le cas échéant).

Les demandes de rachat seront traitées uniquement lorsque le paiement doit être versé au compte enregistré du Participant autorisé. En outre, la Société pourra imposer les restrictions qu'elle estime nécessaires pour s'assurer qu'aucune Action n'est acquise par des Participants autorisés n'ayant pas le statut de Détenteur qualifié.

Le Conseil d'administration peut également, à sa seule et entière discrétion, décider que dans certaines circonstances, il est préjudiciable pour les Actionnaires actuels d'accepter une demande de souscription d'Actions en numéraire ou en nature (ou une combinaison des deux) représentant plus de 5 % de la Valeur liquidative d'un Compartiment. Dans ce cas, le Conseil d'administration peut reporter la demande de souscription et, en concertation avec le Participant autorisé concerné, demander à ce dernier d'échelonner la demande sur une période convenue. Tous les frais de transaction ou dépenses raisonnablement engagés dans le cadre de l'acquisition de ces Actions seront à la charge du Participant autorisé.

La Société de gestion ou l'Agent comptable des registres et Agent des transferts se réservent le droit de demander des précisions supplémentaires à un Participant autorisé. Chaque Participant autorisé doit informer l'Agent comptable des registres et Agent des transferts de tout changement affectant ses informations personnelles et fournir à la Société tous les documents supplémentaires qu'elle pourra lui demander à ce sujet. Les modifications apportées aux renseignements et instructions de paiement fournis par Participant autorisé au moment de son enregistrement ne seront effectives qu'à réception des documents originaux par l'Agent comptable des registres et Agent des transferts.

Des mesures de prévention du blanchiment d'argent peuvent exiger d'un Participant autorisé qu'il fournisse à la Société les renseignements nécessaires pour vérifier son identité (cf. la section « Prévention du blanchiment de capitaux » du présent Prospectus).

La Société précisera les justificatifs d'identité requis, y compris de façon non limitative, un passeport ou une carte d'identité dûment certifiée par une autorité publique (un notaire, la police ou

l'ambassadeur dans le pays de résidence), ainsi qu'un justificatif de l'adresse du Participant autorisé, tel qu'une facture d'eau ou d'électricité ou un relevé bancaire. Dans le cas où le demandeur est une entreprise, il pourra lui être demandée de fournir une copie certifiée conforme du certificat de constitution/extrait Kbis (et de tout changement de raison sociale), de ses règlements, acte constitutif et statuts (ou de tout acte équivalent), ainsi que les noms et adresses de tous les administrateurs et bénéficiaires effectifs.

Il est également entendu que la Société, la Société de gestion et l'Agent comptable des registres et Agent des transferts ne pourront être tenus responsables par le Participant autorisé pour toute perte découlant de l'impossibilité de traiter la souscription si les informations demandées par la Société ou l'Agent comptable des registres et Agent des transferts n'ont pas été fournies par le Participant autorisé.

La Société n'accepte que des Actions soient possédées par une personne physique, société de capitaux ou de personnes ou personne morale qu'à la condition que leurs détenteurs respectent la législation et la réglementation du Luxembourg. C'est pourquoi la Société peut soumettre à restrictions, voire interdire la possession d'Actions si elle est susceptible d'aboutir à la violation d'un quelconque règlement ou d'une quelconque loi du Luxembourg.

Comme la Société n'est pas enregistrée selon le United States Securities Act de 1933 tel qu'il a été amendé, non plus que selon le United States Investment Company Act de 1940 tel qu'il a été amendé, ses Actions ne peuvent être ni proposées ni vendues, directement ou indirectement, aux États-Unis d'Amérique, dans leurs territoires ou possessions ou dans les zones soumises à leur juridiction, non plus qu'à des ressortissants des États-Unis ou des personnes y résidant.

En conséquence, la Société peut exiger de tout souscripteur qu'il lui fournisse toutes informations qu'elle pourra juger nécessaires pour décider s'il est ou non, ou s'il sera, un Détenteur qualifié.

« **Détenteur qualifié** » ou « **Titulaire qualifié** » signifie toute personne qui :

- a) est autorisée à posséder des Actions en vertu de la législation et la réglementation du Luxembourg ; et
- b) n'est pas un Ressortissant américain (« US Person ») et a la qualité d'Acheteur Qualifié (« Qualified Purchaser ») (tel que défini dans le US Investment Company Act de 1940 tel qu'amendé) ; et
- c) n'est pas un Investisseur dans le cadre d'un Plan d'Actionnariat (Benefit Plan

Investor) (tel qu'il est défini dans le US Employee Retirement Income Security Act de 1974 tel qu'amendé) ; et

- d) n'est pas, ou n'est pas apparentée à, un citoyen des États-Unis d'Amérique ou une personne y résidant, non plus qu'une société de personnes ou de capitaux de droit américain ou un certain type de succession ou de fiducie dans la mesure où la possession de quelconques Actions ou d'un quelconque autre type de titres de la Société par une telle personne accroîtrait fortement le risque que la Société soit ou devienne une « société contrôlée par des intérêts étrangers » (controlled foreign corporation) au sens du US Internal Revenue Code de 1986 tel qu'amendé.

La Société se réserve le droit de ne proposer à la souscription dans un État donné qu'une seule Catégorie d'actions afin de respecter la législation, les coutumes ou les pratiques locales ou les objectifs commerciaux de la Société.

Procédure de paiement

La devise de paiement des Actions de chaque Compartiment sera la Devise de référence telle que décrite de façon plus détaillée dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS.

Si le paiement des Actions n'est pas effectué dans les délais voulus, l'émission de ces Actions peut être annulée (ou différée si un Certificat d'Action doit être émis) et il peut être demandé au souscripteur de dédommager la Société de toute perte encourue du fait de cette annulation (comme décrit de façon plus détaillée au paragraphe « Défaut de livraison »).

Le Conseil d'administration se réserve le droit, sans que des intérêts soient dus, de retarder le paiement pour une durée supplémentaire de cinq Jours ouvrés si les conditions de marché sont défavorables et si le Conseil d'administration juge raisonnablement que cela sert l'intérêt bien compris des autres Actionnaires. Cependant, le délai de paiement des Actions rachetées ne dépassera pas 10 Jours ouvrés.

Toutes les Actions rachetées seront annulées par la Société.

Le règlement du transfert des Investissements et/ou les versements en numéraire dans le cadre des souscriptions et des rachats interviendra dans la limite du nombre de Jours ouvrés indiqué dans l'Avis d'opération correspondant (tel que défini ci-après) suivant le Jour de négociation (ou toute date antérieure à la discrétion du Conseil d'Administration). La Société se réserve le droit, à sa seule discrétion, de demander au souscripteur de dédommager la Société pour toutes pertes survenant en raison de la non-

réception d'un paiement par un Compartiment dans les délais de règlement prévus.

Sauf indication contraire dans l'Avis d'opération, le délai de règlement habituel pour les souscriptions directes d'Actions n'excédera pas 5 Jours de règlement après le Jour de négociation concerné.

Sauf indication contraire dans l'Avis d'opération, en cas de rachat, l'Agent comptable des registres et Agent des transferts émettra des instructions de paiement ou de règlement stipulant que celui-ci devra être effectué au plus tard 5 Jours de règlement après le Jour de négociation concerné pour tous les Compartiments. La Société se réserve le droit de reporter le paiement de 5 Jours de règlement supplémentaires, sous réserve que ce report soit dans l'intérêt des autres Actionnaires.

Nonobstant ce qui précède, le paiement du Produit de rachat peut être retardé si des dispositions réglementaires locales spécifiques ou des cas de force majeure échappant au contrôle de la Société ne lui permettent pas de transférer le Produit de rachat ou de réaliser ce paiement dans des délais normaux. Ce paiement sera effectué dès que possible, mais sans intérêt.

Un Avis d'opération détaillant le produit du rachat sera adressé au Participant dans les meilleurs délais après que le Prix de rachat des Actions dont le rachat est demandé aura été déterminé. Les Actionnaires doivent vérifier cet avis d'opération afin de s'assurer que la transaction enregistrée est exempte d'erreurs.

Avis d'opération

Un avis d'opération récapitulant tous les éléments de la transaction (l'« **Avis d'opération** ») sera envoyé au souscripteur (ou à l'agent qu'il aura désigné si le souscripteur le demande) dans les plus brefs délais raisonnables. Les souscripteurs doivent toujours vérifier cet avis d'opération afin de s'assurer que la transaction enregistrée est exempte d'erreurs.

Lorsque leur première souscription est acceptée, les souscripteurs autres que les Participants autorisés se voient attribuer un numéro de compte personnel (le « **Numéro de compte** ») qui, avec les renseignements détaillés sur leur identité et leur adresse, prouve leur identité aux yeux de la Société. Le Numéro de compte doit être utilisé par le souscripteur pour toutes ses transactions futures avec la Société et avec l'Agent comptable des registres et Agent des transferts.

Tout changement de coordonnées d'un souscripteur, ainsi que la perte de son Numéro de compte et la perte ou l'endommagement d'un Certificat d'Action, doivent être portés sans délai à la connaissance de l'Agent comptable des registres et Agent des transferts. À défaut, l'exécution d'une demande de rachat peut être

retardée. La Société se réserve le droit d'exiger une garantie ou autre vérification du droit ou de la revendication du droit d'un souscripteur contresignée par une banque, un courtier en valeurs mobilières ou toute autre partie qu'elle juge acceptable avant d'accepter cette modification.

Si une souscription est totalement ou partiellement rejetée, les fonds versés en paiement ou le solde seront retournés au souscripteur aux risques et périls de celui-ci soit par la poste, soit par virement bancaire.

Suspension du calcul de la Valeur liquidative

La Société n'émettra aucune Action pendant toute période au cours de laquelle le calcul de la Valeur liquidative du Compartiment concerné est suspendu par la Société en vertu des pouvoirs conférés par les statuts (les « **Statuts** ») de la Société et qui sont décrits dans le paragraphe intitulé « Suspension temporaire du calcul de la Valeur liquidative par action ».

Un avis de suspension sera remis aux souscripteurs et les souscriptions effectuées ou en cours pendant une période durant laquelle elles sont suspendues pourront être retirées par une notification écrite reçue par la Société avant la fin de la période de suspension des souscriptions. Les souscriptions qui n'auront pas été retirées seront exécutées le premier Jour de négociation suivant la fin de la période de suspension sur la base de la Valeur liquidative par action calculée le Jour de valorisation concerné.

Prévention du blanchiment de capitaux

Conformément aux règles internationales et à la législation et la réglementation du Luxembourg comprenant, entre autres, la loi du 12 novembre 2004 sur la lutte contre le blanchiment de capitaux et le financement du terrorisme, telle qu'amendée, ainsi que les circulaires de l'autorité de surveillance, tous les professionnels du secteur financier ont l'obligation d'empêcher l'utilisation d'organismes de placement collectif pour le blanchiment de capitaux et le terrorisme. En raison de ces dispositions, l'Agent comptable des registres et Agent des transferts doit, en principe, vérifier l'identité de tout souscripteur conformément à la législation et la réglementation du Luxembourg. L'Agent comptable des registres et Agent des transferts peut demander aux souscripteurs de fournir tout document qu'il juge nécessaire pour procéder à cette identification.

Dans le cas où un souscripteur ne remettrait pas les documents requis ou tarderait à le faire, sa demande de souscription (ou, le cas échéant, de rachat) ne sera pas acceptée. Ni la Société, ni l'Agent comptable des registres et Agent des transferts ne peut être tenu pour responsable du fait qu'une demande de souscription ou de rachat n'est pas exécutée, ou ne l'est qu'avec retard,

parce que le souscripteur n'a pas fourni les documents requis ou n'en a remis qu'une partie.

Il peut être demandé de temps à autre aux Actionnaires de fournir des pièces d'identité supplémentaires ou à jour, conformément aux exigences de la législation et de la réglementation en vigueur sur la diligence raisonnable.

Frais de souscription/rachat

Le prix de souscription des Actions (le « **Prix de souscription** ») est défini comme le « Prix initial » ou le « Prix d'émission » tel qu'il est décrit dans la section intitulée « Les Actions (émission et forme) », majoré de toute Commission de souscription et Frais de transaction sur le marché primaire.

Le prix de rachat des Actions (le « **Prix de rachat** ») est défini comme le « Prix initial » ou le « Prix d'émission » tel qu'il est décrit dans la section intitulée « Les Actions (émission et forme) », majoré de toute Commission de rachat et Frais de transaction sur le marché primaire.

Le Prix de rachat est égal à la Valeur liquidative par Action calculée le Jour de valorisation concerné tel qu'il est défini dans l'Annexe H, *Glossaire*, et sera basé sur les derniers cours de clôture connus, ou autres prix de référence au Jour de valorisation, tels qu'ils sont spécifiés dans l'Annexe sur le compartiment concerné.

Le Prix de rachat d'Actions de toute Catégorie peut être supérieur ou inférieur au Prix de rachat payé par un Actionnaire selon la Valeur liquidative par Action de cette Catégorie à la date du rachat.

En sus du Prix d'émission, la Société de gestion peut facturer au Participant autorisé des Frais de transaction sur le marché primaire liés à cette souscription.

Le Conseil d'administration peut également décider de facturer un montant qu'il juge approprié comme Commission de souscription initiale/Commission de rachat initiale s'élevant, au maximum, à la valeur la plus élevée entre les deux montants suivants :

- 50 000 EUR par demande de souscription (ou l'équivalent dans la devise de la Catégorie d'actions concernée si celle-ci est différente), et
- 5 % du montant, rétrocedé aux tierces parties.

Tout Compartiment devra détenir en permanence des liquidités suffisantes pour honorer toutes demandes de rachat d'Actions.

Sous réserve des dispositions exposées plus bas dans la section intitulée « Suspension temporaire des rachats », les demandes de rachat seront considérées comme contraignantes et irrévocables par la Société et devront être

dûment signées par tous les actionnaires inscrits, sauf dans le cas où le registre des actionnaires indique que des actions sont détenues conjointement et où une procuration à la convenance de la Société lui a été remise.

Opérations en nature et en numéraire

La Société pourra accepter les souscriptions et payer les rachats en nature, en numéraire ou une combinaison des deux.

Les montants minimum de souscription initiale et de rachat applicables aux Participants autorisés peuvent être plus élevés que les montants indiqués dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS.

Afin de lever toute ambiguïté, les montants minimums de souscription initiale et de rachat applicables aux investisseurs autres que des Participants autorisés demeureront ceux indiqués dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS.

1. Opérations en nature

La Société de gestion publiera le Fichier de composition du portefeuille pour les Compartiments détaillant la forme des Investissements et/ou de la Composante en numéraire à livrer (a) par les Participants autorisés en cas de souscription ; ou (b) par la Société en cas de rachat, en échange d'Actions. L'intention actuelle de la Société de gestion est que le Fichier de composition du portefeuille stipule que les Investissements doivent habituellement être sous la forme des composantes des Investissements concernés.

Le Fichier de composition du portefeuille des Compartiments sera disponible chaque Jour de négociation sur demande auprès de la Société de gestion et de l'Intermédiaire concerné.

2. Opérations en numéraire

La Société peut accepter des demandes de souscription et de rachat uniquement en numéraire.

Les Participants autorisés souhaitant demander un rachat en espèces doivent en informer par écrit la Société, sous la diligence de l'Agent comptable des registres et Agent des transferts, et prendre des mesures pour le transfert de leurs Actions vers le compte de la Société.

Si une demande de rachat en numéraire reçue un Jour de valorisation représente plus de 10 % de la Valeur liquidative d'un Compartiment, le Conseil d'administration peut demander à l'Actionnaire concerné d'accepter tout ou partie du paiement sous la forme d'une distribution en nature composée de titres du portefeuille au lieu d'espèces.

Si l'Actionnaire demandant le rachat accepte de recevoir la totalité ou une partie du paiement en nature via des titres du portefeuille du Compartiment correspondant, la Société peut, sans y être obligée, ouvrir un compte à l'extérieur de la Société vers lequel les titres dudit portefeuille vont être transférés. Toute dépense liée à l'ouverture et à la tenue de ce compte sera à la charge de l'Actionnaire. Une fois les actifs du portefeuille transférés sur le compte, celui-ci fera l'objet d'une valorisation par le commissaire aux comptes de la Société qui établira un rapport. Toute dépense liée à l'établissement de ce rapport sera supportée par les Actionnaires concernés, ou tout tiers, à moins que le Conseil d'administration considère que la négociation en nature est dans l'intérêt de la Société (ou du Compartiment concerné) ou qu'elle est effectuée afin de protéger les intérêts de celle-ci.

Le compte sera utilisé pour vendre les titres de ce portefeuille, dont l'équivalent en liquidité sera transféré à l'Actionnaire souhaitant le rachat. Les investisseurs recevant les titres de ce portefeuille au lieu d'un montant en numéraire sont priés de noter que la vente de ces titres peut entraîner des frais de courtage et/ou le paiement d'impôts locaux. En outre, le Produit des rachats issu de la vente des Actions de l'Actionnaire demandant le rachat peut être supérieur ou inférieur au Prix de rachat, en fonction des conditions du marché et/ou de la différence entre les prix utilisés pour calculer la Valeur Liquidative et les cours acheteurs reçus lors de la vente desdits titres du portefeuille dans le délai de règlement du rachat indiqué.

3. Opérations en numéraire dirigées

Si un Participant autorisé demande à ce que des négociations de titres sous-jacents et/ou des opérations de change soient exécutées d'une manière particulière, la Société de gestion mettra en œuvre des efforts raisonnables pour satisfaire cette demande dans la mesure du possible, mais elle ne pourra être tenue responsable si l'exécution n'est pas réalisée de la manière demandée pour quelque raison que ce soit.

Si un Participant autorisé présentant une demande de souscription ou de rachat en nature souhaite que les investissements soient effectués par un courtier particulier, la Société de gestion peut, à sa seule discrétion (sans y être obligée), effectuer ses opérations avec le courtier désigné. Les Participants autorisés souhaitant choisir un courtier sont priés, avant que la Société de gestion n'effectue ses opérations, le cas échéant, de contacter le bureau de négociation du courtier désigné pour organiser l'opération.

La Société de gestion ne sera pas responsable en quoi que ce soit si l'exécution des titres sous-jacents par de courtier désigné, et par extension l'ordre de souscription ou de rachat du Participant autorisé, n'est pas effectué en raison d'une omission, d'une erreur, d'un échec ou d'un

retard d'une négociation ou d'un règlement de la part du Participant autorisé ou du courtier désigné.

Si un Participant autorisé ou le courtier désigné fait défaut ou modifie les conditions d'une quelconque partie de la transaction sur les titres sous-jacents, il devra supporter tous les risques et frais connexes. Dans de telles circonstances, la Société et la Société de gestion auront le droit de traiter avec un autre courtier et de modifier les conditions de la souscription ou du rachat du Participant autorisé, afin de tenir compte du défaut et de la modification des conditions.

Défaut de livraison

Si (i) un Participant autorisé ne livre pas les Investissements et la Composante en numéraire exigés dans le cadre d'une souscription en nature, ou (ii) les espèces requises pour une souscription en numéraire dans les délais de règlement indiqués pour les Compartiments (ils sont précisés sur l'Avis d'opération), la Société de gestion se réserve le droit d'annuler la demande de souscription concernée. Le Participant autorisé devra alors dédommager la Société et la Société de gestion pour toute perte subie par la Société en cas de défaut de livraison par l'Actionnaire/Participant autorisé des Investissements et de la Composante en numéraire ou des espèces requis dans les délais impartis.

Le Conseil d'administration pourra, à sa seule discrétion et lorsque cela est conforme aux intérêts d'un Compartiment, décider de ne pas annuler une souscription lorsqu'un Participant autorisé n'a pas livré les Investissements et la Composante en numéraire ou les espèces requis, selon le cas, dans les délais de règlement prévus. Dans ce cas, la Société peut emprunter temporairement un montant égal à la souscription et l'investir conformément aux politiques et à l'objectif d'investissement du Compartiment concerné. Une fois que les Investissements et la Composante en numéraire ou les espèces requis, selon le cas, auront été reçus, la Société les utilisera pour rembourser l'emprunt. En outre, la Société se réserve le droit de facturer au Participant autorisé concerné les intérêts ou autres frais encourus par la Société du fait de cet emprunt.

Si les Investissements et la Composante en numéraire ou les espèces requis (selon le cas) remis par le Participant Autorisé ne suffisent pas à couvrir ces intérêts ou frais, ou si le Participant autorisé ne les livre pas dans les meilleurs délais possibles, la Société de gestion pourra, à son entière discrétion, annuler l'ordre. Le Participant autorisé devra indemniser la Société et la Société de gestion pour (i) tous les intérêts ou frais encourus (y compris, sans s'y limiter, les frais de transactions liés aux ajustements du portefeuille et les éventuels intérêts appliqués au titre des liquidités empruntées), et (ii) toute perte subie (y compris, sans s'y limiter, toute dépréciation des actifs sous-jacents intervenant entre l'ouverture et la clôture des positions de couverture

(« **Exposition au marché** ») par la Société et la Société de gestion en raison du défaut de livraison.

Une demande de rachat par un Participant autorisé ne sera valide que si le Participant autorisé remplit son obligation de règlement consistant à livrer le nombre requis d'Actions de ce Compartiment à l'Agent administratif dans les délais de règlement applicables (précisés sur l'Avis d'opération). Si un Participant autorisé ne livre pas les Actions requises du Compartiment concerné dans le cadre d'un rachat dans les délais de règlement prévus, la Société et la Société de gestion se réservent le droit (mais ne seront pas tenus) de traiter cela comme un défaut de règlement par le Participant autorisé et d'annuler l'ordre de rachat en question. Le Participant autorisé devra indemniser la Société et la Société de gestion pour toute perte subie par ces dernières du fait de la non-livraison par le Participant autorisé des Actions requises en temps et en heure, y compris (mais sans s'y limiter) les coûts liés à l'Exposition au marché et autres frais encourus par le Compartiment.

Suspension temporaire des rachats

Le droit pour tout Actionnaire de demander le rachat de ses Actions de la Société sera suspendu pendant toute période au cours de laquelle le calcul de la Valeur liquidative par Action du Compartiment concerné est suspendu par la Société en vertu des pouvoirs décrits dans le paragraphe intitulé « Suspension temporaire du calcul de la Valeur liquidative ». Tout Actionnaire demandant le rachat d'Actions sera avisé de la période de suspension. Le retrait d'une demande de rachat ne sera effectif que si une notification écrite parvient à l'Agent comptable des registres et Agent des transferts avant la fin de la période de suspension, faute de quoi les Actions en question seront rachetées le premier Jour de négociation suivant la fin de la période de suspension sur la base du calcul de la prochaine Valeur liquidative par Action.

Rachats forcés

Si, à un instant quelconque, la Société découvre que des Actions appartiennent à une personne qui n'est pas un Détenteur qualifié, soit seul, soit conjointement avec toute autre personne, que ce soit directement ou indirectement, le Conseil d'administration pourra, à sa discrétion et sans que sa responsabilité soit engagée, procéder au rachat forcé des Actions au Prix de rachat décrit ci-dessus après en avoir avisé l'intéressé avec un préavis d'au moins dix jours civils, auquel cas la personne qui n'a pas la qualité de Détenteur qualifié ne sera plus propriétaire de ces Actions dès leur rachat. La Société peut exiger de tout Actionnaire qu'il lui fournisse toutes informations qu'elle pourra juger nécessaires pour décider si ce propriétaire d'Actions est ou non, ou s'il sera, un Détenteur qualifié.

Procédures applicables aux Rachats et Conversions représentant 10 % ou plus de l'actif net de tout Compartiment

Si une demande de rachat en numéraire reçue un Jour de valorisation représente plus de 10 % de la Valeur liquidative d'un Compartiment, la Société, si le Conseil d'administration en décide ainsi et avec le consentement de l'Actionnaire concerné, aura le droit de régler en nature le paiement du Prix de rachat en affectant à celui-ci des investissements du portefeuille constitué pour ces Catégories d'actions dont la valeur, au Jour de valorisation où le Prix de rachat est calculé, soit égale à celle des actions à racheter contre des espèces.

Si une demande de rachat ou de conversion est reçue au cours d'un Jour de valorisation (le « **Premier jour de valorisation** ») et si, soit seule, soit avec les autres demandes analogues reçues à la même date, elle représente plus de 10 % de la Valeur liquidative d'un Compartiment, la Société se réserve le droit, à sa seule et entière discrétion et sans que sa responsabilité soit engagée (et si le Conseil d'administration juge raisonnablement que procéder ainsi sert au mieux l'intérêt des autres actionnaires), de réduire au prorata de ces demandes chaque demande présentée pour ce Premier Jour de valorisation, de telle sorte que les rachats ou conversions effectués ce Premier Jour de valorisation portent sur 10 % au plus de la Valeur liquidative de ce Compartiment.

Dans la mesure où, ce Jour de valorisation, il n'est pas donné plein effet à une quelconque demande de rachat ou de conversion en vertu de l'exercice par la Société de son droit de réduire les demandes au prorata, cette demande sera exécutée, pour le solde restant à honorer, comme si une nouvelle demande avait été présentée par l'Actionnaire en question pour le Premier Jour de valorisation suivant et, si nécessaire, pour les Jours de valorisation suivants, et ce jusqu'à ce que cette demande ait été intégralement satisfaite.

Pour toute demande reçue au titre du Premier Jour de valorisation et dans la mesure où des demandes postérieures sont reçues au titre de Jours de valorisation ultérieurs, ces demandes postérieures seront reportées en priorité jusqu'à ce que les demandes se rapportant au Premier Jour de valorisation soient satisfaites, mais ce sous réserve qu'elles soient traitées selon les modalités décrites plus haut.

CONDITIONS DE CONVERSION D' ACTIONS

En l'absence de mention contraire dans les Annexes, les conversions d'Actions entre Compartiments et entre Catégories d'actions sont possibles selon les modalités ci-dessous. De plus, en l'absence de mention contraire dans les Annexes, il ne sera prélevé aucune commission de conversion.

Les Actionnaires peuvent convertir tout ou partie de leurs Actions en Actions d'une autre Catégorie du même Compartiment ou d'autres Compartiments par une demande spécifiant le nombre d'Actions à convertir dans quels Compartiments, laquelle prendra forme écrite ou sera transmise par fax soit à l'Agent comptable des registres et Agent des transferts, soit au Mandataire.

La demande de conversion doit spécifier soit le montant monétaire, soit le nombre d'Actions que l'Actionnaire souhaite convertir. En outre, la demande de conversion doit inclure la mention des coordonnées de l'Actionnaire ainsi que de son Numéro de compte et, s'il existe, le Certificat d'Action.

Faute de l'une quelconque ces informations, le traitement de la demande de conversion peut être retardé.

Les demandes de conversion doivent être reçues par l'Agent comptable des registres et Agent des transferts avant l'expiration du délai de conversion qui est en vigueur à Luxembourg, à savoir 17 h (le « **Délai de conversion** ») tel qu'il est défini dans l'Annexe sur le Compartiment concerné), et

elles seront exécutées ce Jour de négociation en appliquant la Valeur liquidative calculée le Jour de valorisation en question (selon les modalités décrites à l'Annexe H, *Glossaire*), laquelle reposera sur les derniers cours de clôture disponibles ou autres prix de référence en vigueur ce même Jour de valorisation selon les modalités décrites dans les Annexes concernées.

Toutes les demandes de conversion seront exécutées à une Valeur liquidative inconnue (« fixation des prix à terme »).

Toute demande reçue après l'expiration du Délai de Conversion le Jour de négociation concerné sera exécutée le Jour de négociation suivant sur la base de la Valeur liquidative par action arrêtée au Jour de valorisation concerné.

Les demandes de conversion qui, soit seules, soit cumulées avec les autres demandes du même type reçues au cours d'un Jour de valorisation donné, représentent plus de 10 % de la Valeur liquidative d'un quelconque Compartiment, peuvent être soumises à des procédures supplémentaires telles qu'elles sont décrites dans le paragraphe intitulé « Procédures pour les Rachats et Conversions représentant au moins 10 % de l'actif net d'un Compartiment ».

Le taux auquel tout ou partie des Actions du Compartiment d'origine sont converties en Actions d'un nouveau Compartiment ou d'une nouvelle Catégorie d'actions sera déterminé selon la formule ci-après :

$$A = \frac{(B \times C \times D)}{E}$$

Sachant que :

- A est le nombre d'Actions du nouveau Compartiment ou de la nouvelle Catégorie qui doivent être attribuées ;
- B est le nombre d'Actions du Compartiment ou de la Catégorie d'origine à convertir ;
- C est la Valeur liquidative par Action du Compartiment ou de la Catégorie d'origine arrêtée au Jour de valorisation concerné ;
- D est le taux de change effectivement observé le jour concerné pour la Devise de référence du Compartiment/de la Catégorie d'origine et la Devise de référence du nouveau Compartiment/de la nouvelle Catégorie ;
- E est la Valeur liquidative par Action du nouveau Compartiment ou de la nouvelle Catégorie arrêtée au Jour de valorisation concerné.

À l'issue de la conversion des Actions, l'Agent administratif informera l'Actionnaire du nombre d'Actions du nouveau Compartiment/de la nouvelle Catégorie qu'il a obtenu du fait de la conversion compte tenu de leur prix.

V/ Marché secondaire des ETF ayant le statut d'OPCVM

COTATION EN BOURSE

L'intention de la Société est que pour tous ses Compartiments (ou Catégories d'actions, s'il y a lieu) portant la dénomination d'ETF ayant le statut d'OPCVM (tels que, le cas échéant, ils sont mentionnés dans chaque Annexe correspondante), une Catégorie d'actions au moins soit négociée tout au long de la journée sur au moins un marché réglementé ou une facilité de négociation multilatérale par au moins un teneur de marché prenant des mesures pour faire en sorte que le cours de Bourse de cette Catégorie d'actions ne s'écarte pas sensiblement de sa Valeur liquidative et, le cas échéant, de sa Valeur liquidative indicative (telle qu'elle est définie ci-dessous).

Il est envisagé de déposer une demande de cotation des Catégories d'actions des Compartiments ayant la dénomination d'ETF ayant le statut d'OPCVM sur une ou plusieurs bourses de valeurs.

La liste de ces bourses où les Actions peuvent être achetées et vendues peut être obtenue au siège de la Société.

Sauf mention contraire dans les Annexes concernées, le principal teneur de marché pour tous les Compartiments ayant la dénomination d'ETF ayant le statut d'OPCVM est le bureau de Paris de la Société Générale. Afin de lever toute ambiguïté, d'autres teneurs de marché (qu'ils soient ou non membres du Groupe Société

Générale) pourraient être nommés de temps à autre par la Société pour une ou plusieurs des bourses de valeurs sur lesquelles ces Catégories d'actions sont cotées.

Certains Participants Autorisés qui souscrivent des Actions peuvent jouer un rôle de teneur de marché ; il est prévu que d'autres Participants autorisés souscrivent des Actions afin d'être en mesure de proposer des Actions à l'achat et à la vente à leurs clients, dans le cadre de leur activité de courtier ou de distributeur (broker/dealer).

En ayant la faculté de souscrire ou de racheter des Actions, ces Participants autorisés peuvent favoriser l'émergence d'un marché secondaire liquide efficient au fil du temps sur une ou plusieurs bourses valeurs concernées à mesure qu'ils satisfont la demande du marché secondaire pour ces Actions.

Ce marché secondaire permet à des personnes qui ne sont pas des Participants Autorisés d'acheter ou de vendre des Actions auprès d'autres investisseurs ou teneurs de marché du marché secondaire, de courtiers/distributeurs ou d'autres Participants Autorisés.

L'attention des investisseurs est attirée sur le fait que les jours autres que les Jours ouvrables ou Jours de négociation d'un Compartiment, lorsqu'un ou plusieurs marché(s) échangent des Actions, mais que le ou les marché(s) sous-jacent(s) sur lesquels l'Indice de référence du Compartiment se négocie est fermé, l'écart entre le cours acheteur et le cours demandeur des Actions peut être plus important et la différence entre le prix du marché d'une Action et la dernière Valeur liquidative par Action peut, après conversion de la devise, augmenter.

Les investisseurs doivent également savoir que ces jours-là, l'Indice de référence ne sera pas nécessairement calculé et les investisseurs ne pourront pas s'y référer pour leur prise de décisions, le niveau de l'Indice de référence n'étant pas disponible. Le règlement des opérations sur des Actions sur une ou plusieurs bourses de valeurs concernées s'effectuera par l'intermédiaire des infrastructures d'un ou plusieurs systèmes de compensation et de règlement, selon les procédures applicables sur ces bourses.

VALEUR LIQUIDATIVE INDICATIVE PAR ACTION

La Société pourra, à sa discrétion, mettre à disposition ou désigner d'autres personnes pour mettre à disposition, en son nom, chaque Jour ouvré, une valeur liquidative intrajournalière (la « VLi ») pour un ou plusieurs Compartiments considéré(s) comme des ETF ayant le statut d'OPCVM. Si la Société ou la personne qu'elle a désignée met ces informations à disposition durant tout Jour Ouvré, la VLi sera calculée sur la base des informations disponibles pendant le Jour de négociation ou toute partie du Jour de

négociation et elle reposera ordinairement sur la valeur actuelle des actifs/expositions du Compartiment et/ou de l'indice financier en question, le cas échéant corrigée du taux de change concerné, qui est en vigueur ce Jour Ouvré plus tout montant en espèces que détenait ce Compartiment le Jour Ouvré précédent. La Société ou la personne qu'elle aura désignée mettra à disposition une VLi si une quelconque Bourse concernée le demande.

Une VLi n'est pas et ne doit pas être considérée comme étant la valeur d'une d'Action ou le prix auquel des Actions peuvent être souscrites, rachetées, achetées ou vendues sur une bourse de valeurs concernée. En particulier, une VLi fournie pour un Compartiment lorsque les composantes de l'indice financier concerné ne sont pas activement négociées au moment de sa publication peut ne pas refléter fidèlement la valeur d'une Action, être trompeuse et ne doit pas être considérée comme fiable.

L'attention des investisseurs est attirée sur le fait que le calcul de et les comptes rendus sur une quelconque VLi peuvent être affectés par des retards si les cours des titres faisant partie de l'indice arrivent plus tardivement que d'autres valeurs calculées reposant sur ces mêmes titres comme, par exemple, l'indice financier concerné ou la VLi d'autres fonds indiciaires cotés reposant sur ce même indice financier. Les investisseurs qui envisagent d'acheter ou vendre des Actions sur une bourse de valeurs concernée ne doivent pas se fier uniquement à la VLi mise à disposition quand ils prennent des décisions sur leurs investissements, mais doivent aussi prendre en considération d'autres informations de marché et facteurs pertinents, économiques ou autres (y compris, s'il y a lieu, les informations sur l'indice financier en question, les titres qui entrent dans sa composition et les instruments financiers reposant sur l'indice financier correspondant au Compartiment concerné).

Des renseignements supplémentaires sur la VLi d'un ou plusieurs Compartiments considérés comme des ETF ayant le statut d'OPCVM peuvent, sous réserve des conditions et limites imposées par l'opérateur du marché en question, être fournis sur le site Internet du marché boursier sur lequel ces Actions sont cotées. Ces renseignements sont aussi disponibles sur la page dédiée à l'action en question sur Reuters ou Bloomberg. Des informations supplémentaires sur les codes Bloomberg et Reuters correspondant à la VLi de toute Catégorie d'actions cotée sur une bourse figurent également dans la section Fiches techniques du site Internet www.amundiETF.com.

PROCÉDURE D'ACHAT ET DE VENTE SUR LE MARCHÉ SECONDAIRE

Le marché secondaire est le marché sur lequel les Actions peuvent être achetées et/ou vendues directement sur une bourse de valeurs (le « **Marché secondaire** »).

Aucun seuil d'achat et/ou de vente n'est appliqué aux achats et/ou ventes d'Actions sur le Marché secondaire en dehors de la quotité de négociation qui peut être exigée par la bourse de valeurs concernée.

La Société ne prélèvera aucune commission d'achat ou de vente concernant l'achat ou de la vente des Actions d'un ETF ayant le statut d'OPCVM cotées sur une quelconque bourse de valeurs. Certains intermédiaires de marché peuvent cependant facturer des frais de courtage ou d'autres types de commissions. Ces commissions ne reviennent pas à la Société.

En général, les Actions des Compartiments achetées sur le Marché secondaire ne peuvent pas être rachetées par la Société. Les investisseurs doivent acheter et vendre ces Actions sur le Marché secondaire avec l'aide d'un intermédiaire (par ex. un courtier), ce qui peut entraîner des commissions. Au surplus, les investisseurs peuvent payer un prix supérieur à la valeur liquidative actuelle des Actions lorsqu'ils les achètent et le prix qu'ils reçoivent lorsqu'ils les vendent peut être inférieur à leur valeur liquidative actuelle.

En cas de Suspension de séance sur le Marché secondaire (telle qu'elle est définie ci-dessous) qui n'est pas motivée par un Événement affectant la Liquidité de l'Indice (tel qu'il est défini ci-dessous), la Société de gestion permettra aux Actionnaires de procéder au rachat de leurs Actions sur le Marché primaire à un prix fondé sur la Valeur liquidative par Action en vigueur sous réserve que le calcul de la Valeur liquidative par Action ne soit pas lui-même suspendu en vertu de la réglementation en vigueur et/ou du Prospectus et/ou des Statuts.

« **Suspension du Marché secondaire** » désigne toute situation dans laquelle il est impossible aux Actionnaires de vendre leurs Actions sur toutes les Bourses de valeurs où le Compartiment concerné est coté pendant une durée d'au moins trois Jours ouvrés depuis la survenance de (i) la suspension des cotations par l'opérateur de marché ou (ii) l'impossibilité d'effectuer des transactions sur la Bourse de valeurs concernée constatée par tous les Actionnaires et qui est due soit :

- i. à une variation significative du cours de Bourse des Actions du Compartiment qui y sont cotées par comparaison avec leur valeur liquidative indicative ;
- ii. soit à l'absence de Participants autorisés, soit à l'incapacité des Participants autorisés d'honorer leur engagement d'exercer leur activité en maintenant une présence permanente sur le marché, ce qui rend impossible la négociation des Actions en question sur le lieu de cotation où cette catégorie d'actions est admise à la cote.

« **Événement affectant la Liquidité de l'Indice** » signifie tout événement perturbant un marché et/ou tout problème de liquidité affectant tout ou partie des composantes de l'Indice et qui aboutit à la suspension de leur appréciation boursière.

La procédure de rachat ci-après (la « **Procédure** ») s'appliquera lors de la Suspension du Marché secondaire. Les ordres de rachat initiés en cas de Suspension du Marché secondaire seront envoyés par tout Actionnaire concerné à l'intermédiaire financier faisant fonction de teneur de compte de ses Actions (l'« Intermédiaire concerné ») ; ils préciseront (i) le nombre d'Actions à racheter et la date de rachat souhaitée, et (ii) seront accompagnés d'une copie de l'avis publié par la Société de gestion sur son site Internet (www.amundiETF.com) présentant la décision d'étendre le Marché primaire (la « Notification d'extension du Marché primaire ») pour toute Catégorie d'actions concernée d'un Compartiment.

Les demandes de rachat traitées dans ces circonstances seront relayées par le truchement de l'Intermédiaire concerné à un membre d'Euroclear France avant d'être transmises par ce membre à l'agent de précentralisation du Compartiment en question, à savoir « Société Générale SGSS/CHB/SET/DIR/NANT, 32 avenue du Champ de Tir, BP 81 236, 44312 NANTES CEDEX 3, FRANCE ».

L'agent de précentralisation susmentionné expédiera les demandes de rachat à l'Agent comptable des registres et Agent des Transferts.

Selon les arrangements qui auront été conclus entre l'Intermédiaire concerné et les autres sociétés d'investissement participant à la chaîne de rachat, des contraintes et délais supplémentaires, et des commissions peuvent avoir à être payées à des intermédiaires ; c'est pourquoi les Actionnaires sont invités à contacter leur Intermédiaire concerné pour obtenir des informations supplémentaires sur ces éventuelles contraintes et/ou commissions (étant entendu que les commissions prélevées par cet Intermédiaire ne reviendront pas à la Société de Gestion).

Les explications qui précèdent sont un résumé de la Procédure qui sera exposée de façon plus détaillée dans la Notification d'extension du Marché primaire.

Les demandes de rachat traitées dans ces circonstances conformément aux termes de la Procédure ne seront soumises à aucun seuil de détention potentiellement applicable et les Commissions de rachat initiales seront composées uniquement du droit de sortie tel qu'il est décrit pour chaque Compartiment dans l'Annexe correspondante.

VI/ Divers**CHARGES DE LA SOCIÉTÉ**

La Société (ou chaque Compartiment ou Catégorie d'actions, le cas échéant, au prorata) paiera une commission de gestion et une commission d'administration, exprimées en pourcentage de sa Valeur liquidative, selon les informations présentées pour chaque Compartiment en Annexe C - SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS.

Sont réputées constituer une Commission de gestion (ci-après la « **Commission de gestion** ») les commissions qui rémunèrent la Société de gestion pour les services fournis en relation avec le Compartiment concerné et tous les autres prestataires de services, y compris les distributeurs.

Sont réputées constituer une commission d'administration (ci-après la « **Commission d'administration** ») les commissions et dépenses de la Société qui sont généralement basées sur les actifs nets des Compartiments ou Catégories d'actions concernés, le cas échéant, et qui comprennent, sans s'y limiter :

- les honoraires des firmes professionnelles, telles que les réviseurs d'entreprises et les conseils juridiques ;
- les redevances gouvernementales, frais réglementaires, droits d'enregistrement, frais de représentants locaux, frais de commercialisation transfrontalière et frais liés à la cotation en bourse ;
- les coûts liés à la fourniture d'informations aux actionnaires, tels que les coûts de création, de traduction, d'impression et de distribution des rapports financiers, des prospectus et des documents DIC ;
- les dépenses extraordinaires, notamment pour les expertises légales ou autres nécessaires pour défendre les intérêts des actionnaires ;
- tous les autres coûts associés à l'exploitation et à la distribution, y compris les dépenses engagées par la Société de gestion, le Dépositaire et tous les prestataires de services dans le cadre de l'acquittement de leurs responsabilités envers la Société.

Cette Commission d'administration comprend également tous les autres coûts encourus par la Société de gestion pour maintenir et exploiter les Compartiments.

Frais non inclus dans la Commission de gestion ou la Commission d'administration figurant à l'Annexe C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS :

- les impôts sur les actifs et les revenus ;
- les frais de courtage et les frais bancaires standard encourus sur les transactions commerciales et les opérations sur titres ;
- toute rémunération que le conseil accepte que la Société paie aux administrateurs indépendants pour leurs services au sein du conseil (aucune rémunération de ce type n'est payée à l'heure actuelle) ;
- les frais et les coûts supportés par les agents d'Amundi Asset Management pour centraliser les ordres et garantir la meilleure exécution ; certains de ces agents peuvent être des sociétés affiliées à Amundi.

La Société peut soit directement payer la Commission de gestion et la Commission d'administration à la Société de gestion (qui, le cas échéant, paiera ensuite le Prestataire de services), soit directement les verser aux Prestataires de services concernés, comme défini ci-dessous.

POLITIQUE DE DISTRIBUTION

Sauf mention contraire (i) dans les Annexes ou (ii) sauf si le Conseil d'administration en décide autrement, la Société n'a pas l'intention de distribuer les revenus de ses placements ou les plus-values nettes réalisées, en tout ou en partie. C'est pourquoi le Conseil d'administration recommandera le réinvestissement des bénéfices de la Société et, en conséquence, aucun dividende ne sera payé aux Actionnaires.

En tout état de cause, aucun dividende ne sera distribué s'il a pour effet de faire tomber le capital de la Société en dessous du minimum requis par la législation luxembourgeoise.

Cependant, le Conseil d'administration peut proposer à l'Assemblée générale des Actionnaires de payer un dividende en espèces s'il considère que cela est de l'intérêt des Actionnaires ; dans ce cas, sous réserve de l'accord des Actionnaires, un dividende en espèces pourra être prélevé sur le revenu net des investissements disponible et les plus-values nettes de la Société.

Sur la proposition du Conseil d'administration, l'Assemblée générale des Actionnaires peut aussi décider de distribuer aux Actionnaires un dividende sous forme d'Actions d'un ou plusieurs Compartiments proportionnellement au nombre d'Actions de ces Compartiments qu'ils détiennent.

Il est prévu que, pour les Actions de distribution de certains Compartiments (voir les Annexes), la Société distribue des dividendes en espèces dans la Devise de référence de ces Compartiments. Les dividendes annuels afférents à ces Actions de distribution sont

déclarés à l'Assemblée générale ordinaire des Actionnaires. Les Administrateurs ont aussi la faculté de déclarer des acomptes sur dividende.

Le Conseil d'administration peut aussi décider que les dividendes seront automatiquement réinvestis par l'achat d'Actions supplémentaires. Dans ce cas, les dividendes seront payés à l'Agent comptable des registres et Agent des Transferts, lequel en réinvestira le montant dans des Actions supplémentaires de la même Catégorie pour le compte des Actionnaires. Ces Actions seront émises à la date de paiement sous forme nominative et à un prix égal à la Valeur liquidative par action de la Catégorie en question.

Les fractions d'Actions nominatives seront comptabilisées pour chaque Catégorie selon les modalités énoncées dans l'Annexe concernée.

Les dividendes déclarés qui n'auront pas été réclamés dans les cinq ans suivant leur date d'échéance seront perdus et reviendront à la Société. Aucun intérêt ne sera payé sur les dividendes déclarés et qui sont détenus et mis à la disposition de leur bénéficiaire par la Société.

FISCALITÉ

Les informations ci-après reposent sur la législation et les pratiques administratives en vigueur au Luxembourg à la date du présent Prospectus et sont sujettes à modification. La Société, la Société de gestion et leurs sociétés affiliées ne dispensent pas de conseils fiscaux. Le traitement fiscal des investissements dépend des circonstances individuelles de l'investisseur. Si un investisseur a le moindre doute quant à sa situation fiscale, il doit consulter un conseiller fiscal professionnel.

La Société

Une Taxe d'abonnement égale à (i) 0,01 % par an pour toutes les Catégories d'actions dédiées aux investisseurs institutionnels et à (ii) 0,05 % par an pour les Catégories dédiées aux investisseurs de détail sera due trimestriellement aux autorités du Luxembourg, sur la base du calcul des actifs nets de chaque compartiment le dernier jour du trimestre.

La part des actifs d'un Compartiment investie dans d'autres OPC luxembourgeois n'est pas assujettie à la taxe susmentionnée.

Les Compartiments (i) dont les titres sont cotés ou négociés sur une bourse de valeurs reconnue ou sur un autre marché réglementé au fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public et (ii) dont l'unique objet est la réplique de la performance d'un ou plusieurs indices, ne sont pas assujettis à la taxe susmentionnée.

En cas d'existence de plusieurs Catégories d'actions dans un Compartiment concerné, l'exemption s'applique uniquement aux

Catégories d'actions remplissant les conditions visées ci-dessus en (i).

À la date du présent Prospectus, la Société n'était redevable au Luxembourg d'aucun impôt en dehors d'une taxe de 1 250 EUR qui a été versée une fois pour toutes par la Société au moment de sa constitution.

Les revenus issus de dividendes et d'intérêts reçus par la Société peuvent être soumis à des retenues à la source dont le taux varie d'un pays à l'autre. Ces retenues à la source ne sont généralement pas récupérables.

Actionnaires

Le Conseil de l'Union européenne a adopté le 3 juin 2003, la Directive européenne sur l'épargne n° 2003/48/CE portant sur les revenus de l'épargne sous forme d'intérêts, laquelle a été transposée dans le droit national du Luxembourg par la loi du 12 avril 2005 (la « **Loi de 2005** »). En vertu des dispositions de la Loi de 2005, les personnes physiques résidant dans un État membre de l'Union européenne qui ont investi dans des actifs situés dans un autre État membre de l'Union européenne peuvent être soumises à un impôt.

La directive relative à la fiscalité de l'épargne de l'UE (« directive épargne ») a été abrogée par la directive 2015/2060 du Conseil du 10 novembre 2015 avec effet au 1er janvier 2016. Cependant, pendant une période transitoire, la directive épargne de l'UE continue de s'appliquer, notamment en ce qui concerne les obligations de communication et l'étendue des informations à fournir par l'agent payeur au Luxembourg (au sens de la directive épargne de l'UE) et les obligations des États membres relativement à la délivrance du certificat de résidence fiscale et à l'élimination de la double imposition.

Par suite de l'abrogation de la directive épargne de l'UE, la Loi de 2005 cessera de s'appliquer, sous réserve des dispositions relatives aux obligations mentionnées ci-dessus et de la période transitoire prévue par ladite directive du Conseil.

Le 9 décembre 2014, le Conseil de l'Union européenne a adopté la Directive 2014/107/UE modifiant la Directive 2011/16/UE du 15 février 2011 relative à la coopération administrative dans le domaine fiscal, qui prévoit désormais un échange automatique d'informations sur les comptes financiers entre États membres (la « **Directive DAC** »), en ce compris les catégories de revenus visées par la directive épargne de l'UE. L'adoption de la directive précitée met en œuvre la Norme commune de déclaration de l'OCDE et généralise l'échange automatique de renseignements au sein de l'Union européenne à partir du 1er janvier 2016.

Dans ce cadre, les mesures de coopération prévues par la directive épargne européenne doivent être remplacées par la mise en œuvre de la Directive DAC qui prévaudra également en cas de chevauchement de leurs champs d'application. L'Autriche ayant été autorisée à différer l'application de la Directive DAC d'une année au plus par rapport aux autres États membres, des dispositions transitoires particulières s'appliquent à ce pays en vertu de cette dérogation.

En outre, le Luxembourg a signé l'accord multilatéral entre autorités compétentes de l'OCDE (« **Accord multilatéral** ») activant l'échange automatique de renseignements dans le cadre de la NCD. En vertu de cet Accord multilatéral, le Luxembourg échangera automatiquement des renseignements relatifs aux comptes financiers avec d'autres pays signataires à compter du 1er janvier 2016.

La loi du 18 décembre 2015 concernant l'échange automatique de renseignements en matière fiscale qui transpose la Directive DAC et l'Accord multilatéral dans le droit luxembourgeois a été publiée au journal officiel le 24 décembre 2015 et est entrée en vigueur le 1er janvier 2016 (la « **Loi NCD** »).

Il appartient aux Actionnaires de se renseigner et, le cas échéant, de demander des conseils sur l'incidence des modifications apportées à la directive épargne de l'UE, de la mise en œuvre de la Directive DAC et de l'accord multilatéral au Luxembourg et dans leur pays de résidence sur leur investissement.

ÉCHANGE AUTOMATIQUE DE RENSEIGNEMENTS

La Société peut être soumise à la Norme d'échange automatique de renseignements relatifs aux comptes financiers en matière fiscale (la « **Norme** ») et à sa Norme commune de déclaration (la « **NCD** »), aux fins établies dans la Loi NCD.

Selon les termes de la Loi NCD, la Société peut être traitée comme un Établissement financier luxembourgeois déclarant. En tant que tel, à compter du 30 juin 2017, et sans préjudice des autres dispositions applicables relatives à la protection des données, établies dans les documents de la Société, il sera demandé à la Société, entre autres, de déclarer annuellement à l'Administration des Contributions Directes (l'« **ACD** ») les renseignements personnels et financiers ayant trait à l'identification, la participation et aux paiements) concernant (i) certains investisseurs selon les termes de la loi NCD (les « **Personnes devant faire l'objet d'une déclaration** ») et (ii) les personnes exerçant un contrôle (à savoir, les personnes physiques qui exercent un contrôle sur une entité, conformément aux recommandations émises par le GAFI - les « **Personnes détenant le contrôle** ») sur certaines entités non

financières (les « **NFE** »), elles-mêmes Personnes devant faire l'objet d'une déclaration. Parmi ces informations, détaillées de façon exhaustive dans l'Annexe I de la Loi NCD (les « **Informations** »), figureront des données personnelles sur les Personnes devant faire l'objet d'une déclaration.

Pour que la Société puisse satisfaire à ses obligations en vertu de la Loi NCD chaque investisseur devra lui fournir lesdites Informations accompagnées des pièces justificatives requises. Dans ce cadre, les investisseurs sont informés que, en tant que contrôleur de données, la Société traitera les Informations aux fins exposées dans la Loi NCD. Les investisseurs s'engagent à informer les Personnes exerçant un contrôle sur eux, le cas échéant, du traitement des Informations par la Société.

Les investisseurs sont en outre informés que les Informations concernant les Personnes devant faire l'objet d'une déclaration, au sens de la Loi NCD, seront communiquées annuellement à l'ACD aux fins établies dans la Loi NCD. Les investisseurs sont notamment informés que la Société de gestion, ou ses représentants, peuvent demander aux investisseurs de fournir de temps en temps des informations concernant l'identité et le domicile des titulaires de comptes financiers (y compris certaines entités et les Personnes qui en détiennent le contrôle) pour vérifier leur statut au sens de la NCD et de déclarer les informations concernant un actionnaire et son compte à l'ACD.

Les investisseurs s'engagent en outre à informer immédiatement la Société de tous changements relatifs aux Informations dès la survenance de ces derniers.

Tout investisseur ne répondant pas aux demandes d'Informations ou de documents de la Société peut être passible de sanctions imposées à la Société et imputables au manquement de cet investisseur de fournir les Informations qui doivent faire l'objet d'une déclaration de la Société à l'ACD, conformément à la législation nationale applicable.

La Société se réserve le droit de refuser toute demande de souscription si les informations fournies (ou non fournies) ne répondent pas aux exigences de la Loi NCD.

Les investisseurs sont invités à consulter leurs propres conseillers à l'égard des incidences d'ordre fiscal et des autres conséquences possibles de l'application de la NCD.

INVESTISSEMENT DURABLE

Règlement sur la publication d'informations

Le 18 décembre 2019, le Conseil européen et le Parlement européen ont annoncé avoir conclu un accord politique sur le Règlement sur la publication d'informations, cherchant ainsi à

établir un cadre paneuropéen pour faciliter l'investissement durable. Le Règlement sur la publication d'informations prévoit une approche harmonisée en ce qui concerne les communications relatives à la durabilité aux investisseurs dans le secteur des services financiers de l'Espace économique européen.

Le champ d'application du Règlement sur la publication d'informations est extrêmement large, couvrant une très vaste gamme de produits financiers (par exemple, fonds d'OPCVM, fonds d'investissement alternatifs, régimes de pension, etc.) et de participants aux marchés financiers (par exemple, gestionnaires de placements et conseillers agréés par l'UE). Il vise à instaurer plus de transparence sur la manière dont les acteurs des marchés financiers intègrent les Risques en matière de durabilité dans leurs décisions d'investissement et la prise en compte des impacts négatifs sur la durabilité dans le processus d'investissement. Ses objectifs sont (i) de renforcer la protection des investisseurs en lien avec les produits financiers, (ii) d'améliorer la transmission des informations aux investisseurs par les acteurs des marchés financiers et (iii) d'améliorer la transmission des informations aux investisseurs concernant les produits financiers pour permettre, entre autres, aux investisseurs de prendre des décisions d'investissement éclairées.

Aux fins du Règlement sur la publication d'informations, la société de gestion remplit les critères pour être considérée comme un « acteur des marchés financiers », tandis que la Société et les Compartiments sont tous qualifiés de « produits financiers ».

Règlement Taxinomie

Le Règlement Taxinomie vise à identifier les activités économiques qui peuvent être qualifiées d'écologiquement durables (les « Activités durables »).

L'Article 9 du Règlement Taxinomie identifie ces activités en fonction de leur contribution à l'atteinte de six objectifs environnementaux : (i) l'atténuation des changements climatiques ; (ii) l'adaptation aux changements climatiques ; (iii) l'utilisation durable et la protection de l'eau et des ressources marines ; (iv) la transition vers une économie circulaire ; (v) la prévention et le contrôle de la pollution ; (vi) la protection et restauration de la biodiversité et des écosystèmes.

Une activité économique est qualifiée d'écologiquement durable lorsqu'elle contribue de manière substantielle à un ou plusieurs des six objectifs environnementaux, qu'elle ne nuit de manière significative à aucun des cinq autres objectifs environnementaux (principe de « ne pas nuire de manière significative », « do no significant harm » ou « DNSH ») et qu'elle est réalisée dans le respect des garanties minimales prévues à l'Article 18 du Règlement Taxinomie et

respecte les critères techniques de sélection qui ont été établis par la Commission européenne conformément au Règlement Taxinomie. Le principe « ne pas nuire de manière significative » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents aux Compartiments qui prennent en compte les critères de l'Union européenne sur les activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents du reste des Compartiments pertinents ne tiennent pas compte des critères de l'UE sur les activités économiques durables sur le plan environnemental.

Les Compartiments identifiés à l'Article 8 ou à l'Article 9 dans leurs Annexes respectives peuvent s'engager ou non à investir, à la date du présent Prospectus, dans des activités économiques qui contribuent à l'atteinte des objectifs environnementaux énoncés à l'Article 9 du Règlement Taxinomie.

Pour plus d'informations sur l'approche d'Amundi concernant le Règlement Taxinomie, veuillez vous référer à l'Annexe V – Publications d'informations ESG du présent Prospectus et à la Déclaration réglementaire ESG d'Amundi sur www.amundi.lu.

Règlement délégué (UE) 2022/1288 de la Commission du 6 avril 2022

Le Règlement délégué de la Commission (UE) 2022/1288, établissant les RTS, a été publié le 25 juillet 2022 dans le Journal officiel de l'UE (JO). Les RTS seront applicables à partir du 1er janvier 2023.

Conformément à l'art. 14 alinéa 2 des RTS, des informations sur les caractéristiques environnementales ou sociales des compartiments visés à l'art. 8 sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

Conformément à l'art. 18 alinéa 2 des RTS, des informations sur les investissements durables des compartiments visés à l'art. 9 sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

Pour plus de détails sur la façon dont un Compartiment se conforme aux exigences du Règlement sur la publication d'informations, du Règlement Taxinomie et des RTS, veuillez vous référer à l'Annexe du Compartiment pertinent, aux états financiers annuels du Fonds, ainsi qu'à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

Aperçu de la Politique d'Investissement Responsable

Depuis sa création, le groupe de sociétés Amundi (« Amundi ») a placé l'investissement responsable et la responsabilité des entreprises parmi ses piliers fondateurs, convaincu que les acteurs économiques et financiers ont une

grande responsabilité envers la pérennité de la société et que les éléments Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG) sont des moteurs de la performance financière à long terme.

Amundi considère qu'en plus des aspects économiques et financiers, l'intégration des dimensions ESG, dont les facteurs de durabilité et les risques en matière de durabilité, dans le processus de décision d'investissement permet une évaluation plus complète des risques et des opportunités d'investissement.

Intégration des Risques liés à la durabilité par Amundi

L'approche d'Amundi en matière de risques de durabilité repose sur trois piliers : une politique d'exclusion ciblée, l'intégration des scores ESG dans le processus d'investissement et la gestion.

Par conséquent, Amundi exclut les fabricants d'armes controversées de la plupart de ses compartiments gérés passivement, comme indiqué dans la description de chaque compartiment. Amundi a également développé une gamme de compartiments gérés passivement qui reproduisent des indices qui prennent explicitement en compte les risques en matière de durabilité et les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité dans leurs méthodologies. Pour cette gamme spécifique de compartiments passivement gérés, le processus de gestion exclut les sociétés en contradiction avec la Politique d'Investissement Responsable, comme celles qui ne respectent pas les conventions internationales, les cadres internationalement reconnus ou les réglementations nationales.

De plus, Amundi a développé sa propre approche de notation ESG. La notation ESG d'Amundi vise à mesurer la performance ESG d'un émetteur, c'est-à-dire sa capacité à anticiper et à gérer les risques et les opportunités en matière de durabilité inhérents à son secteur et à sa situation particulière.

Le processus de notation ESG d'Amundi repose sur l'approche « Best-in-class ». Des notations adaptées à chaque secteur d'activité visent à évaluer la dynamique dans laquelle les entreprises évoluent.

La notation et l'analyse ESG sont effectuées au sein de l'équipe d'analyse ESG d'Amundi, qui est également utilisée comme une contributrice indépendante et complémentaire dans le processus de décision.

La notation ESG d'Amundi est une note ESG quantitative basée sur sept notes, allant de A (la meilleure) à G (la pire). Dans l'échelle de notation ESG d'Amundi, les titres appartenant à la liste d'exclusion correspondent à une note de G.

La performance ESG des entreprises émettrices est évaluée par comparaison avec la performance moyenne de leur secteur, au travers des trois dimensions ESG :

1. Dimension environnementale : elle examine la capacité des émetteurs à contrôler leur impact environnemental direct et indirect, en limitant leur consommation d'énergie, en réduisant leurs émissions de gaz à effet de serre, en luttant contre l'épuisement des ressources et en protégeant la biodiversité.
2. Dimension sociale : elle mesure le fonctionnement d'un émetteur selon deux concepts distincts : la stratégie de l'émetteur pour développer son capital humain et le respect des droits de l'homme en général.
3. Dimension de gouvernance : elle évalue la capacité de l'émetteur à garantir la base d'un cadre de gouvernance d'entreprise efficace et à générer de la valeur à long terme.

La méthodologie appliquée lors de la notation ESG d'Amundi fait appel à 38 critères (au 2 janvier 2023), qui peuvent être génériques (communs à toutes les sociétés quelle que soit leur activité) ou être spécifiques à un secteur. Les critères sont pondérés par secteur, et leur impact sur la réputation, l'efficacité opérationnelle et la conformité réglementaire de l'émetteur est pris en compte.

Pour plus d'informations sur les 38 critères pris en compte par Amundi (au 2 janvier 2023), veuillez vous référer à la Politique d'Investissement Responsable et à la Déclaration réglementaire ESG d'Amundi disponibles sur www.amundi.lu.

La notation ESG d'Amundi tient également compte des impacts négatifs potentiels des activités de l'émetteur sur la durabilité (principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité, tels que déterminés par Amundi), y compris sur les indicateurs suivants :

- Émissions de gaz à effet de serre et performance énergétique (critères relatifs aux émissions et à l'utilisation de l'énergie)
- biodiversité (critères relatifs aux déchets, au recyclage, à la biodiversité, à la pollution et à la Gestion responsable des forêts)
- eau (critères relatifs à l'eau)
- déchets (critères relatifs aux déchets, au recyclage, et à la pollution)
- questions sociales et de personnel (critères relatifs à l'implication communautaire et aux droits de l'homme, critères relatifs aux pratiques d'emploi, critères relatifs à la structure de gouvernance, critères relatifs aux relations de travail et critères relatifs aux soins et à la sécurité)

- droits de l'homme (critères d'engagement communautaire et des droits de l'homme)
- Lutte contre la corruption (critères éthiques)

L'activité de gestion fait partie intégrante de la stratégie ESG d'Amundi. Amundi a développé une activité de gestion active par l'engagement et le vote. La Politique d'engagement d'Amundi s'applique à tous les fonds Amundi et est incluse dans la Politique d'investissement responsable.

Des informations plus détaillées sont incluses dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi et dans la Déclaration réglementaire ESG d'Amundi, disponibles sur la page www.amundi.com.

Intégration de l'approche du Risque en matière de durabilité d'Amundi au niveau du Compartiment

Les Compartiments classés conformément à l'article 8 du Règlement sur la publication d'informations visent à promouvoir des caractéristiques environnementales ou sociales et à investir dans des sociétés qui respectent des bonnes pratiques de gouvernance. Sauf mention contraire dans leurs politiques d'investissement, ces Compartiments excluent tous les émetteurs spécifiés dans la liste d'exclusion de la Politique d'Investissement Responsable, comme indiqué ci-dessus.

Principale incidence négative

Les Principales incidences négatives (« PIN ») sont des impacts négatifs, importants ou susceptibles d'être importants sur les facteurs de durabilité qui sont causés, aggravés par ou directement liés aux décisions d'investissement de l'émetteur.

Pour les Compartiments gérés passivement, Amundi tient compte des PIN via une combinaison d'approches : exclusions, engagement, vote, suivi des controverses.

Pour les Compartiments visés à l'art. 8 et à l'art. 9 du Règlement sur la publication d'informations, Amundi prend en compte les PIN de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS s'appliquant à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles) et d'approches d'engagement et de vote.

Pour tous les autres Compartiments non classés en vertu de l'art. 8 de l'art. 9 du Règlement sur la publication d'informations, Amundi tient compte d'une sélection de PIN à travers sa politique d'exclusion normative et, pour ces Compartiments, seul l'indicateur n° 14 (Exposition aux armes controversées, mines anti-personnel, armes à sous-munitions, armes chimiques et armes biologiques) de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS sera pris en compte.

Tous les autres Compartiments non classés en vertu de l'art. 8 de l'art. 9 du Règlement sur la publication d'informations tiennent compte de la principale incidence négative des investissements sur les facteurs de durabilité dans leur processus d'investissement en excluant les titres de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées. Ces compartiments ne tiennent pas compte des risques en matière de durabilité dans leur processus d'investissement, car leur objectif est de reproduire le plus fidèlement possible la performance d'un indice de référence qui ne prend pas en compte ces risques dans sa méthodologie.

Ces Compartiments ne tiennent pas compte des risques en matière de durabilité dans leur processus d'investissement, car leur objectif est de reproduire le plus fidèlement possible la performance d'un indice de référence qui ne prend pas en compte ces risques dans sa méthodologie.

Des informations plus détaillées sur les Principales incidences négatives sont incluses dans la Déclaration réglementaire ESG d'Amundi disponible sur www.amundi.com.

LA RÈGLE VOLCKER

Les modifications législatives et réglementaires adoptées aux États-Unis sont importantes pour Crédit Agricole, les Compartiments et les Actionnaires. Le 21 juillet 2010, le Président Obama a promulgué le Dodd-Frank Act. La section 619 du Dodd-Frank Act et ses règlements d'application (communément appelée la « **Règle Volcker** » limitent, entre autres, la capacité d'une entité bancaire, telle que la plupart des entités du Groupe Crédit Agricole, à acquérir ou conserver toute participation ou à agir en tant que sponsor d'un « fonds visé » (y compris à agir en tant que « commodity pool operator » pour ce dernier), le terme comprenant les « hedge funds » et les « fonds de private equity ».

La Règle Volcker exclut de la définition de « fonds visé » les fonds étrangers faisant appel à l'épargne publique qui satisfont à certains critères.

Pour être considéré comme un fonds étranger faisant appel à l'épargne publique, un Compartiment doit remplir les conditions suivantes :

- 1) il doit opérer ou être domicilié hors des États-Unis (en ce compris tout État, possession ou territoire) ;
- 2) les participations dans le Compartiment peuvent être offertes et vendues aux investisseurs de détail dans la juridiction dont relève le fonds ;
- 3) les participations dans le Compartiment sont vendues principalement par le biais d'une ou plusieurs offre(s) publique(s) en dehors des États-Unis (le fait de

vendre « principalement » en dehors des États-Unis implique que, dans le cadre de l'offre initiale, au moins 85 % des participations dans le véhicule d'investissement sont placées auprès d'investisseurs qui ne sont pas résidents des États-Unis) ;

- 4) si le Compartiment est effectivement détenu par des investisseurs de détail,
 - a. il doit être coté sur une bourse, dans le cas d'un ETF ;
 - b. s'il ne s'agit pas d'un ETF, il doit être effectivement détenu par des investisseurs de détail auxquels il est accessible moyennant un montant minimum d'investissement ne dépassant pas 25 000 euros ;
- 5) les documents d'offre publique doivent être mis à la disposition du public.
- 6) une condition supplémentaire est applicable aux entités bancaires constituées ou implantées aux États-Unis eu égard aux fonds étrangers faisant appel à l'épargne publique vis-à-vis desquels ils agissent en qualité de promoteur : les participations dans le fonds sont vendues principalement à des personnes distinctes de l'entité bancaire promotrice constituée ou établie aux États-Unis, du fonds étranger faisant appel à l'épargne publique, des affiliés de l'entité bancaire promotrice américaine et du fonds étranger faisant appel à l'épargne publique, ainsi que des administrateurs et employés de ces entités.

La date effective légale de la Règle Volcker est le 21 juillet 2012 et toute entité bancaire, sous réserve de certaines exceptions, disposait d'un délai de trois ans (soit jusqu'au 21 juillet 2015) pour la mise en conformité de ses activités et de ses investissements. La Réserve fédérale a accordé un délai supplémentaire de deux fois un an aux « fonds visés existants » qui étaient en place avant le 31 décembre 2013, repoussant la date de mise en conformité au 21 juillet 2017 pour ces fonds.

La Société de gestion et ses Entités affiliées ne donnent aucune garantie aux Actionnaires quant au traitement du Compartiment au titre de la Règle Volcker. Il est recommandé aux Actionnaires de demander des conseils juridiques en ce qui concerne les implications de la Règle Volcker sur tout achat d'Actions dans les Compartiments.

LA SOCIÉTÉ – INFORMATIONS GÉNÉRALES

La Société a été constituée le 29 mars 2006 en tant que société d'investissement à capital variable de droit luxembourgeois pour une durée illimitée et avec un capital de 31 100 EUR. La Société est régie par les dispositions de la

Partie I de la Loi de 2010. Son siège se trouve au Luxembourg.

Les statuts de la société ont été déposés au *Registre de Commerce et des Sociétés* de Luxembourg et publiés dans le *Mémorial C, Recueil des Sociétés et Associations* (le « *Mémorial* ») le 14 avril 2006. La Société est immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le numéro B 115 129.

Les Statuts peuvent être amendés de temps à autre par une assemblée générale des Actionnaires sous réserve des exigences de quorum et de majorité stipulées par la législation du Luxembourg.

La Société a le statut de Sicav à compartiments et émettra des Actions des différents Compartiments dans plusieurs Catégories. Les Administrateurs feront en sorte que chaque Compartiment dispose d'un portefeuille séparé.

La Société ne constitue qu'une seule entité juridique vis-à-vis des tiers, mais par dérogation à l'article 2093 du Code civil du Luxembourg, les actifs d'un Compartiment donné ne peuvent être employés que pour honorer les dettes, engagements et obligations de ce Compartiment. Les actifs, engagements, frais et dépenses qui ne peuvent être affectés à un Compartiment en particulier seront imputés aux différents Compartiments proportionnellement à leur actif net respectif et au prorata temporis si cela est approprié au regard des montants considérés.

En ce qui concerne les relations entre les Actionnaires, chaque Compartiment est considéré comme une entité juridique distincte.

La devise de base de la Société est l'euro aux fins des comptes consolidés.

GESTION ET ADMINISTRATION

Le Conseil d'administration

Le conseil d'administration (le « **Conseil d'administration** »), dont les noms des membres (les « Administrateurs ») figurent au début du présent Prospectus, est responsable des informations présentées dans le présent Prospectus. Il a pris tout le soin nécessaire pour garantir qu'à la date de ce Prospectus, les informations qui y sont divulguées sont exactes et complètes sur tous les points importants. Le Conseil d'administration en assume la responsabilité en conséquence.

Bien que la Société délègue ses fonctions de gestion et d'administration à la Société de gestion (comme décrit dans le paragraphe suivant), le Conseil d'administration demeure responsable de la direction, du contrôle et de l'administration de la Société ainsi que de la détermination de l'ensemble de ses politiques et objectifs d'investissement.

Aucun contrat de prestation de services n'a été conclu et n'est envisagé entre l'un quelconque des Administrateurs et la Société, bien que les Administrateurs aient droit à une rémunération conforme aux pratiques usuelles du marché.

La Société de gestion

En vertu de la loi de 2010, le Conseil d'administration a désigné Amundi Luxembourg S.A. comme sa Société de gestion.

Le 1er janvier 2024, Amundi Luxembourg S.A. a remplacé Amundi Asset Management en tant que Société de gestion en vertu du chapitre 15 de la loi de 2010.

La Société de gestion a été constituée le 20 décembre 1996 pour une durée de 99 (quatre-vingt-dix-neuf) ans. Son siège se trouve au Luxembourg.

La Société de Gestion est responsable de la gestion des investissements, des services administratifs, des services de commercialisation et des services de distribution.

À la date du Prospectus, la Société de gestion agissait aussi en qualité de société de gestion pour d'autres fonds d'investissement. Les noms de ces autres fonds sont disponibles sur demande auprès de la Société de gestion.

La Société de Gestion a la possibilité de déléguer à des tiers tout ou partie de ses responsabilités. Par exemple, tant qu'elle conserve le contrôle et la surveillance, la Société de gestion peut nommer un ou plusieurs gestionnaires de placements pour se charger de la gestion quotidienne des actifs des Compartiments, ou un ou plusieurs conseillers pour fournir des informations, des recommandations et des recherches au sujet d'investissements existants et potentiels.

La Société de gestion peut aussi nommer différents prestataires de services, y compris ceux énumérés ci-dessous, et peut nommer des distributeurs pour commercialiser et distribuer les Actions des Compartiments dans toute juridiction où les Actions sont autorisées à la vente.

La Société de gestion a conçu et mis en œuvre une politique de rémunération qui est compatible avec, et promeut, une gestion saine et efficace des risques par le recours à un business model qui, par nature, n'encourage pas la prise de risques excessifs, notamment des risques non compatibles avec le profil de risque des Compartiments.

La Société de gestion a identifié les membres de son personnel dont l'activité professionnelle a un impact substantiel sur les profils de risque des Compartiments et veillera à ce que la politique de rémunération leur soit appliquée.

La politique de rémunération intègre la gouvernance, une structure équilibrée entre les parts fixes et variables ainsi que les règles concernant les risques et l'alignement des performances à long terme. Ces règles d'alignement sont conçues de manière à être compatibles avec la stratégie, les objectifs, les valeurs et les intérêts de la Société de gestion, la Société et les actionnaires, et comprennent des mesures visant à éviter les conflits d'intérêts.

La Société de gestion veille à ce que le calcul de toute rémunération basée sur les performances repose sur les performances à long terme de la Société et que le paiement effectif de ce type de rémunération s'échelonne sur la même période.

Les détails de la politique de rémunération actuelle de la Société de gestion, y compris une description de la façon dont la rémunération et les avantages sont calculés, ainsi que l'identité des personnes responsables de l'attribution de la rémunération et de ces avantages, sont disponibles sur <https://www.amundi.lu/retail/Local-Content/Footer/Quick-Links/Regulatory-information/Amundi>. Une copie papier de ces informations est disponible gratuitement pour les investisseurs, sur demande, au siège social de la Société de gestion.

La politique de vote concernant les titres détenus par la Société mise en œuvre par la Société de gestion ainsi que le rapport rendant compte des conditions d'exercice de ces droits de vote sont accessibles sur le site Internet de la Société de gestion, à l'adresse : <https://www.amundi.com> section legal documentation.

Les investisseurs pourront interroger la Société de gestion sur le détail de l'exercice des droits de vote sur chaque résolution présentée à l'assemblée générale d'un émetteur donné dès lors que la participation consolidée par la Société de gestion aura dépassé le seuil de détention fixé dans la Politique de vote. Une absence de réponse de la part de la Société de gestion pourra être interprétée, à l'issue d'un délai d'un mois, comme indiquant qu'elle a exercé ses droits de vote conformément aux principes posés dans la Politique de vote.

Le Gestionnaire d'investissement

Pour chaque Compartiment, la Société de Gestion peut déléguer ses fonctions de gestion d'actifs à un Gestionnaire d'investissement. Sauf indication contraire dans l'Annexe du Compartiment concerné, la Société de gestion a délégué ses fonctions de gestion d'actifs à Amundi Asset Management, dont le siège social est établi au 91-93 Boulevard Pasteur 75730 Paris Cedex 15P.

À titre de rémunération pour ses services, le Gestionnaire de placements est en droit de percevoir une commission telle que spécifiée dans l'Annexe C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS.

Pour chaque Compartiment, le Gestionnaire d'investissement peut déléguer tout ou partie de ses fonctions à un ou plusieurs Gestionnaires financiers par délégation, comme défini dans l'Annexe du Compartiment concerné. Si tel est le cas, l'identité de ce ou ces Gestionnaires d'investissement sera indiquée dans l'Annexe du Compartiment concerné.

Distributeur et Mandataire

La Société de gestion peut nommer, sous sa responsabilité et son contrôle, une ou plusieurs banques, institutions financières et autres intermédiaires autorisés, Distributeurs et Mandataires chargés d'offrir et de vendre les Actions aux investisseurs et de traiter les demandes de souscription, de rachat, de conversion ou de transfert des actionnaires. Sous réserve de la législation des pays où les Actions sont offertes, ces Intermédiaires peuvent, avec l'accord du Conseil d'administration et du Dépositaire, agir en qualité de mandataires pour un investisseur.

En cette qualité, un Intermédiaire demandera la souscription, la conversion ou le rachat d'Actions pour le compte de son client et demandera que ces opérations soient consignées au nom de cet Intermédiaire dans le Registre des Actionnaires du Compartiment concerné.

Nonobstant ce qui précède, tout actionnaire est libre d'investir directement dans la Société sans recourir aux services d'un mandataire. Le contrat conclu entre la Société et tout mandataire inclura une disposition donnant à l'actionnaire le droit d'exercer son droit de propriété sur les Actions souscrites par l'intermédiaire du mandataire. Le Mandataire n'aura pas le droit de prendre part aux votes aux assemblées générales des actionnaires, sauf si l'actionnaire qui l'a mandaté lui accorde une procuration écrite pour ce faire.

Tout investisseur peut demander à tout moment par écrit que les Actions soient inscrites à son nom, auquel cas, à la remise de la lettre de confirmation du Mandataire à l'Agent comptable des registres et Agent des transferts par cet investisseur, l'Agent comptable des registres et Agent des transferts consignera le transfert correspondant et le nom de l'investisseur dans le registre des actionnaires et avisera le Mandataire en conséquence.

Cependant, les dispositions qui précèdent ne s'appliquent pas aux actionnaires qui ont acquis des Actions dans des pays où le recours à un mandataire (ou autre Intermédiaire) est nécessaire ou obligatoire pour des raisons pratiques ou pour des raisons légales ou réglementaires.

Pour toute souscription, tout Intermédiaire autorisé à agir en qualité de mandataire est censé déclarer au Conseil d'administration que :

a) l'investisseur est un Détenteur qualifié ;

b) il informera sans délai le Conseil d'administration et l'Agent comptable des registres et Agent des transferts s'il apprend qu'un investisseur a perdu la qualité de Détenteur qualifié ;

c) dans le cas où il serait investi d'un pouvoir discrétionnaire pour des Actions dont le bénéficiaire effectif est une personne qui n'a pas la qualité de Détenteur qualifié, l'Intermédiaire fera en sorte que ces Actions soient rachetées ;

d) et il ne transférera ni ne livrera sciemment une Action ou partie d'Action, non plus qu'un quelconque droit sur des Actions à une personne qui n'a pas la qualité de Détenteur qualifié, et aucune Action ne sera transférée à destination des États-Unis.

Le Conseil d'administration peut exiger à tout instant des Intermédiaires agissant en qualité de Mandataire qu'ils effectuent toutes déclarations supplémentaires qui sont nécessaires pour se conformer à une quelconque modification de la législation et de la réglementation en vigueur.

La liste des Mandataires peut être obtenue au siège de la Société.

Le Dépositaire

Société Générale Luxembourg est le dépositaire et agent de paiement de la Société (le « **Dépositaire** »).

Le Dépositaire est une filiale du groupe Société Générale, un établissement de crédit basé à Paris. Le Dépositaire est une société à responsabilité limitée luxembourgeoise, enregistrée auprès du Registre du commerce et des sociétés du Luxembourg sous le numéro B 6061, dont le siège social se situe 11, avenue Émile Reuter, L-2420 Luxembourg. Son centre opérationnel se situe au 28-32, place de la Gare, L-1616 Luxembourg. Il s'agit d'un établissement de crédit au sens de la loi du 5 avril 1993 relative au secteur financier, telle qu'amendée.

Le Dépositaire exercera ses fonctions et obligations conformément aux articles 33 à 37 de la loi 2010 et au Règlement délégué (UE) 2016/438 de la Commission du 17 décembre 2015 complétant la directive sur les OPCVM (le « Règlement européen de niveau 2 »). La relation entre la Société, la Société de gestion et le Dépositaire est régie par un contrat de dépositaire et agent payeur conclu pour une durée illimitée (le « **Contrat avec le Dépositaire et Agent payeur** »).

Conformément à la Loi de 2010 et en vertu du Contrat avec le Dépositaire et Agent payeur, le Dépositaire assure, entre autres, la garde des actifs de la Société et le suivi des flux de trésorerie, ainsi que le suivi et la supervision de certaines tâches de la Société.

En outre, Société Générale Luxembourg agira en tant qu'agent payeur principal de la Société. En cette qualité, la fonction principale de Société Générale Luxembourg sera d'assurer le déroulement des procédures liées au paiement des distributions et, le cas échéant, des produits de rachat liés aux Actions.

Le Dépositaire peut déléguer les services de conservation des actifs (tel que cela est défini dans le Contrat avec le Dépositaire et Agent payeur) aux Délégués à la conservation des actifs (tel que cela est défini dans le Contrat avec le Dépositaire et Agent payeur) dans les conditions prévues dans le Contrat avec le Dépositaire et Agent payeur, et conformément à l'article 34bis de la Loi de 2010 et aux articles 13 à 17 du Règlement européen de niveau 2. La liste des Délégués à la conservation des actifs est disponible ici : <https://www.securities-services.societegenerale.com/fr/solutions/conservation-globale/>.

Le Dépositaire est également autorisé à déléguer tout service en vertu du Contrat avec le Dépositaire autre que les Services de supervision et les Services de suivi des flux de trésorerie (tel que cela est défini dans le Contrat avec le Dépositaire).

Le Dépositaire est responsable envers la Société pour toute perte liée aux Actifs détenus en dépôt (tel que cela est défini dans le Contrat avec le Dépositaire et Agent payeur et conformément à l'article 18 du Règlement européen de niveau 2) par le Dépositaire ou le Délégué à la conservation des actifs. Dans ce cas, le Dépositaire sera tenu de restituer des Actifs détenus en dépôt du même type ou le montant correspondant à ces derniers sans retard, à moins que le Dépositaire ne prouve que la perte est survenue à la suite d'un événement échappant à son contrôle, dont les suites auraient été inévitables malgré tous les efforts déployés.

Lorsqu'il exerce toute autre responsabilité en vertu du Contrat avec le Dépositaire et Agent payeur, le Dépositaire se doit d'agir avec la compétence, le soin et la diligence dont un dépositaire professionnel exerçant le même type d'activité est raisonnablement censé faire preuve. Le Dépositaire est responsable envers la Société pour toute autre perte (autre qu'une perte liée aux Actifs détenus en dépôt décrite ci-dessus) résultant d'une négligence, d'une mauvaise foi, d'une fraude ou d'un manquement de la part du Dépositaire (et de ses administrateurs, dirigeants, ou employés).

La responsabilité du Dépositaire en ce qui concerne les Services de conservation des actifs ne sera pas affectée par une délégation telle que visée à l'article 34bis de la loi de 2010, et ne fera pas l'objet d'une exclusion ou d'une limitation par le contrat.

Le Contrat avec le Dépositaire est conclu pour une durée illimitée. Les parties à celui-ci peuvent le résilier moyennant un préavis écrit de quatre-vingt-dix (90) jours calendaires. Dans le cas d'une résiliation du Contrat avec le Dépositaire, un nouveau dépositaire sera désigné. Jusqu'à ce qu'il soit remplacé ou, le cas échéant, révoqué, le dépositaire démissionnaire doit continuer à exécuter ses obligations de garde (uniquement) et, à cet égard, il est tenu de prendre toutes les mesures nécessaires pour sauvegarder les intérêts des actionnaires.

Le Dépositaire n'est responsable d'aucune décision d'investissement de la Société ou de l'un de ses agents, ni des conséquences de ces décisions sur la performance d'un Compartiment donné.

Le Dépositaire n'est pas autorisé à exercer des activités en rapport avec la Société pouvant créer des conflits d'intérêts entre la Société, les actionnaires et le Dépositaire, à moins que le Dépositaire n'ait identifié correctement tout conflit d'intérêts potentiel et n'ait séparé sur le plan fonctionnel et hiérarchique l'exécution des tâches liées à ses dépositaires de ses autres tâches pouvant générer un conflit avec ces dernières, et que les conflits d'intérêts potentiels ne soient clairement identifiés, gérés, surveillés et communiqués aux actionnaires.

À cet égard, le Dépositaire a mis en place une politique de prévention, de détection et de gestion des conflits d'intérêt résultant de la concentration des activités du Groupe Société Générale ou de la délégation des fonctions de garde à d'autres entités de la Société Générale ou à une entité liée à la Société de gestion.

Cette politique de gestion de conflits d'intérêts veille à :

- (a) identifier et analyser des situations potentielles de conflits d'intérêts ;
- (b) enregistrer, gérer les situations de conflits d'intérêts et en effectuer le suivi grâce à :
 - la mise en place de mesures permanentes en vue de gérer les conflits d'intérêts, telles que la séparation des tâches, la séparation des liens hiérarchiques et fonctionnels, le suivi de listes d'initiés et la mise en place d'environnements informatiques dédiés ;
 - la mise en œuvre, au cas par cas :
 - de mesures préventives appropriées, notamment créer une liste de suivi ad hoc, instaurer de nouvelles murailles de Chine, vérifier que les transactions sont traitées de manière adéquate et/ou informer les clients concernés ;

- ou le refus de gérer des activités pouvant créer de possibles conflits d'intérêts.

Ainsi, le Dépositaire, en sa qualité, d'un côté, de dépositaire et agent de paiement et, de l'autre côté, d'agent administratif ainsi que d'agent comptable des registres et des transferts de la Société, a établi une séparation fonctionnelle, hiérarchique et contractuelle entre l'exercice de ses fonctions de dépositaire et l'exécution des tâches sous-traitées par la Société.

L'Agent administratif

La Société de gestion a nommé Société Générale Luxembourg Agent administratif.

Dans l'exercice de ces fonctions, Société Générale Luxembourg est chargée de fournir les services administratifs requis par la législation luxembourgeoise tels que le calcul de la Valeur liquidative, la tenue de la comptabilité de la Société et toutes les autres fonctions administratives qui sont requises par la législation du Grand-Duché de Luxembourg et sont décrites de façon plus approfondie dans le contrat susmentionné.

Sous réserve de l'accord préalable de la Société de gestion et du respect des législations et réglementations en vigueur, l'Agent administratif est autorisé à déléguer l'exercice ou l'exécution de certain(e)s devoirs et missions.

Société Générale Luxembourg est une société anonyme de droit luxembourgeois détenue à 100 % par Société Générale.

Son siège social se trouve au 11, avenue Émile Reuter, L-2420 Luxembourg et son centre opérationnel au 28-32, Place de la gare, L-1616 Luxembourg. Son activité principale consiste en la prestation de services de banque d'entreprise, de gestion privée et de dépositaire. Au 1er juillet 2009, son capital entièrement libéré s'élevait à 1 389 042 648 EUR.

Le contrat susmentionné peut être dénoncé par écrit à l'initiative de l'une ou l'autre des parties avec un préavis de quatre-vingt-dix jours, ou avec effet immédiat dans certaines circonstances.

L'Agent social et Agent domiciliaire

La Société de gestion a nommé Arendt Services S.A. Agent social et Agent domiciliaire.

Dans l'exercice de ces fonctions, Arendt Services S.A. est tenue de :

- (a) identifier les membres du conseil d'administration de la Société, ses actionnaires et ses bénéficiaires effectifs ultimes ;
- (b) conserver dans ses dossiers toute la documentation nécessaire à

l'identification des personnes susmentionnées pendant une période d'au moins 5 ans après la fin des relations avec ces personnes et/ou avec la Société ;

- (c) se conformer et répondre à toute demande légale que les autorités chargées de l'application de la loi pourraient lui adresser dans l'exercice de leur pouvoir ;
- (d) coopérer pleinement avec les autorités luxembourgeoises chargées de la lutte contre le blanchiment d'argent (i) en leur fournissant toutes les informations nécessaires conformément à la législation applicable et (ii) en informant d'office, conformément à la loi luxembourgeoise, le Procureur d'État auprès du Tribunal d'Arrondissement de Luxembourg de tout fait qui pourrait constituer un indice de blanchiment d'argent ou de financement du terrorisme.

Arendt Services S.A. est une société anonyme de droit luxembourgeois, ayant son siège social au 9, rue de Bitbourg, L-1273 Luxembourg, immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le numéro B 145 917.

L'Agent comptable des registres et Agent des transferts

La Société de gestion a nommé Société Générale Luxembourg Agent comptable des registres et Agents de transfert.

Société Générale Luxembourg est une société anonyme de droit luxembourgeois.

Son siège social se trouve au 28-32, Place de la Gare, L-1616 Luxembourg.

L'Agent comptable des registres et Agent de transfert est responsable, entre autres, du traitement des demandes de souscription, de rachat et de conversion d'Actions et de l'acceptation des transferts de fonds, de la tenue du Registre des actionnaires de la Société, de la délivrance de Certificats d'Actions sur demande, de la sauvegarde de tous les Certificats d'Actions de la Société qui n'ont pas été émis, de l'acceptation des Certificats d'Actions restitués pour remplacement, rachat ou conversion et de la fourniture et de l'expédition aux actionnaires, sous sa supervision, des déclarations, rapports, notifications et autres documents tels qu'ils sont décrits de façon plus approfondie dans le contrat susmentionné.

Avec l'accord préalable de la Société de gestion et dans le respect des lois et règlements applicables, l'Agent comptable des registres peut sous-traiter l'exercice ou l'exécution de certaines de ses tâches et obligations.

Dissolution et liquidation de la Société

La Société peut à tout moment être dissoute par une décision de l'assemblée générale des actionnaires statuant aux conditions de quorum et de majorité telles qu'elles sont définies dans les Statuts de la Société.

Le Conseil d'administration doit soumettre la question de la dissolution et de la liquidation de la Société à l'assemblée générale des actionnaires toutes les fois que le capital tombe en dessous des deux tiers du minimum requis par la Loi de 2010. L'assemblée générale, pour laquelle aucun quorum ne sera requis, statuera à la majorité simple des suffrages exprimés des Actions présentes et votantes.

La question de la dissolution et de la liquidation de la Société sera également soumise à l'assemblée générale des actionnaires toutes les fois que le capital tombe en dessous d'un quart du capital minimum. Dans ce cas, l'assemblée générale ne sera soumise à aucune exigence de quorum et la dissolution pourra être décidée par les actionnaires détenant un quart des droits de vote qui sont présents ou représentés à l'assemblée.

L'assemblée doit être convoquée de telle sorte qu'elle ait lieu dans un délai de quarante jours à partir du moment où il est établi que l'actif net de la Société est tombé en dessous des deux tiers ou, le cas échéant, du quart du minimum légal.

L'émission d'Actions nouvelles de la Société prendra fin à la date de publication de l'avis de convocation de l'assemblée générale des actionnaires à laquelle la dissolution ou la liquidation de la Société sera proposée.

Cet avis sera publié dans au moins deux journaux, dont un sera un journal luxembourgeois.

L'assemblée générale nommera un ou plusieurs liquidateurs pour réaliser les actifs de la Société, au mieux des intérêts des actionnaires et sous la supervision de l'autorité de surveillance compétente.

Le produit de la liquidation de chaque Compartiment, net de tous les frais de liquidation, sera réparti par les liquidateurs entre les titulaires d'Actions de chaque Catégorie à raison de leurs droits respectifs. Conformément à la législation luxembourgeoise, les sommes qui n'auront pas été réclamées par les actionnaires à l'issue du processus de liquidation seront déposées à la Caisse de Consignation du Luxembourg jusqu'à l'expiration du délai légal de prescription prévu par la législation du Luxembourg.

Dissolution d'un Compartiment/d'une Catégorie d'actions

Le Conseil d'administration peut décider à tout instant de dissoudre tout Compartiment ou Catégorie d'actions. En cas de dissolution d'un Compartiment/d'une Catégorie d'actions, le

Conseil d'administration pourra proposer aux actionnaires de ce Compartiment/cette Catégorie d'actions, soit la conversion de leurs Actions en Catégories d'actions d'un autre Compartiment ou d'une autre Catégorie d'actions du même Compartiment aux conditions fixées par le Conseil d'administration, soit le rachat de leurs Actions en espèces à un prix égal à leur Valeur liquidative par Action (y compris tous les frais et dépenses causés par la dissolution) calculée le Jour de valorisation selon les modalités décrites dans l'Annexe H, *Glossaire*.

Dans le cas où, pour quelque raison que ce soit, la valeur de l'actif de tout compartiment ou Catégorie d'actions d'un Compartiment est tombée à moins de 50 millions d'euros ou à un niveau, quel qu'en soit le montant, dont le Conseil d'administration détermine, selon les modalités décrites dans l'Annexe, qu'il est le niveau minimum requis pour que ce Compartiment ou cette Catégorie d'actions fonctionne de manière efficiente d'un point de vue économique, ou si un changement de l'environnement politique ou économique de ce Compartiment ou cette Catégorie d'actions est susceptible d'avoir des effets néfastes importants sur les investissements de ce Compartiment, le Conseil d'administration pourra décider (i) le rachat forcé de toutes les Actions du Compartiment ou de la Catégorie d'actions en question de ce compartiment à un prix égal à la Valeur liquidative par action (en tenant compte du prix auquel ses investissements sont effectivement réalisés et des frais de réalisation) calculée le Jour de valorisation où cette décision prend effet ou (ii) de proposer aux Actionnaires du Compartiment ou de la Catégorie d'actions concerné la conversion de leurs Actions en Actions d'un autre Compartiment ou d'une autre Catégorie d'actions.

La Société enverra un avis écrit aux Actionnaires du Compartiment ou de la Catégorie d'actions concernés avant la date effective de ce Rachat forcé, avec les raisons motivant ce rachat ainsi que ses modalités. En l'absence de décision contraire adoptée dans l'intérêt des Actionnaires ou destinée à préserver l'égalité de traitement entre eux, les Actionnaires du Compartiment ou de la Catégorie d'actions concernés pourront continuer à demander le rachat ou la conversion sans frais de leurs Actions avant la date d'entrée en vigueur du rachat forcé en tenant compte du prix et des frais de réalisation effectifs des investissements.

Toute demande de souscription sera suspendue à partir de l'annonce de la dissolution, de la fusion ou du transfert du Compartiment ou de la Catégorie d'actions concernés.

Nonobstant les pouvoirs conférés au Conseil d'administration par le premier paragraphe des présentes, l'assemblée générale des Actionnaires d'une quelconque Catégorie d'actions d'un Compartiment ou Catégorie d'actions peut, sur la proposition du Conseil d'administration, racheter la totalité des Actions

de ce Compartiment ou Catégorie d'actions et rembourser aux Actionnaires la Valeur liquidative de leurs Actions (compte tenu du prix et des frais de réalisation effectifs des investissements) calculée le Jour de valorisation où cette décision prend effet. Cette assemblée générale des Actionnaires ne sera soumise à aucune condition de quorum et statuera par une résolution adoptée à la majorité simple des Actionnaires présents ou représentés.

Les actifs qui n'ont pu être distribués à leurs propriétaires au moment de l'exécution du rachat seront déposés à la *Caisse de Consignation* du Luxembourg pour le compte des personnes qui y ont droit.

Toutes les Actions rachetées seront ensuite annulées par la Société.

Fusion et scission de Compartiments

Le Conseil d'administration peut décider de procéder à une fusion (en vertu des principes définis par la loi de 2010) des actifs et passifs de la Société ou d'un Compartiment avec ceux (i) d'un autre Compartiment existant dans la Société ou un autre Compartiment existant dans un autre OPCVM luxembourgeois ou étranger ou (ii) d'un autre OPCVM luxembourgeois ou étranger. Dans ce cas précis, le Conseil d'administration pourra décider ou autoriser la date d'entrée en vigueur de la fusion. Cette fusion sera régie pas les conditions et procédures imposées par la loi, notamment concernant les termes de la fusion établis le Conseil d'administration et les informations fournies aux Actionnaires.

Le Conseil d'administration pourra aussi décider d'absorber (i) un Compartiment d'un autre OPC luxembourgeois ou étranger, indépendamment de leur forme ou (ii) un OPC luxembourgeois ou étranger non constitué en société. Sans porter atteinte aux dispositions plus strictes et/ou spécifiques contenues dans la loi ou réglementation applicable, la décision du Conseil d'administration sera publiée (soit dans les journaux à définir par le Conseil d'administration ou par le biais d'un avis adressé aux Actionnaires concernés à l'adresse indiquée sur le registre des Actionnaires) un mois avant la date d'entrée en vigueur de la fusion afin de permettre aux Actionnaires de demander, pendant cette période, le rachat ou le remboursement de leurs parts ou si possible leur conversion en Actions dans un autre Compartiment présentant un investissement similaire, sans frais en plus de ceux retenus par le Compartiment pour compenser les frais de désinvestissement. À expiration de cette période, la décision d'absorption sera applicable à tous les Actionnaires qui n'ont pas exercé ce droit. Le taux de change entre les Actions concernées de la Société et celles de l'OPC absorbé ou du Compartiment associé sera calculé à la date d'effet de l'absorption sur la base de la Valeur liquidative par Action à cette date.

Nonobstant les pouvoirs conférés au Conseil d'administration par les précédents paragraphes, les Actionnaires de la Société ou les Actionnaires du/des Compartiment(s) concerné(s), selon les cas, pourront aussi prendre des décisions sur les fusions ou absorptions décrites ci-dessus et concernant la date effective de celles-ci par une résolution sans exigence de quorum et adoptée à la majorité simple des voix exprimées. Lorsque la Société est l'entité absorbée qui cesse donc d'exister à la suite de la fusion, l'assemblée générale des Actionnaires de la Société doit fixer la date d'entrée en vigueur de la fusion. Cette assemblée générale prendra sa décision par résolution sans exigence de quorum et cette dernière sera adoptée par majorité simple des voix exprimées.

En marge des principes susmentionnés, la Société pourra absorber un autre OPC luxembourgeois ou étranger constitué en société conformément à la loi luxembourgeoise en date du 10 août 1915 sur les sociétés commerciales et ses amendements.

Si le Conseil d'administration considère qu'il est nécessaire dans les intérêts des Actionnaires du Compartiment ou qu'un changement de la situation économique ou politique en lien avec le Compartiment concerné est survenu pouvant le justifier, le Conseil d'administration pourra décider de scinder un Compartiment. En cas de scission de Compartiments, les Actionnaires existants des Compartiments concernés pourront demander, dans un délai de trente jours après avoir été avertis et la survenue d'un tel événement, le rachat de leurs Actions par la Société sans frais de rachat.

Toute demande de souscription, rachat et conversion sera suspendue à compter de l'annonce de la division du Compartiment concerné.

Réorganisation des Catégories d'actions

Le Conseil d'administration peut décider de réorganiser les Catégories d'actions, ainsi qu'il est décrit ci-après, si, pour une raison quelconque, il estime que :

1. La Valeur liquidative d'une Catégorie d'action a baissé, ou n'a pas atteint, le niveau minimum pour opérer de façon efficace ; ou
2. des changements intervenus dans l'environnement juridique, économique ou politique justifieraient cette réorganisation ; ou
3. la rationalisation des produits justifierait cette réorganisation.

Dans ce cas, le Conseil d'administration peut décider de réattribuer l'actif et le passif d'une quelconque Catégorie d'actions à ceux d'une

autre ou de plusieurs autres Catégories d'action et de désigner les Actions de la Catégorie concernée en tant qu'Actions de cette ou ces autre(s) Catégorie(s) (après avoir procédé, le cas échéant, à un fractionnement ou un regroupement et avoir versé aux porteurs de Parts le montant correspondant à tout droit relatif au fractionnement).

En outre, les actionnaires seront informés en temps voulu de cette réorganisation par notification écrite, avant la mise en place de cette réorganisation. La notification sera publiée et/ou communiquée aux actionnaires conformément à la section PUBLICATION DES NOTIFICATIONS. La notification expliquera les motifs de la réorganisation et le processus de celle-ci.

Assemblées générales

L'assemblée générale des Actionnaires aura lieu au siège de la Société le premier vendredi du mois d'avril de chaque année (ou, s'il n'est pas un Jour ouvré, le premier jour suivant qui est un Jour ouvré au Luxembourg) à 10 h.

Les actionnaires de tout Compartiment peuvent tenir à tout moment une assemblée générale pour statuer sur toutes affaires concernant exclusivement ce Compartiment. De plus, les actionnaires de toute Catégorie d'actions peuvent tenir à tout moment une assemblée générale pour statuer sur toutes affaires concernant exclusivement cette Catégorie d'actions.

Tous les avis de convocation aux assemblées seront expédiés par la poste à tous les actionnaires inscrits à l'adresse figurant en regard de leur nom dans le registre des actionnaires au moins huit jours avant la date fixée pour cette assemblée. L'avis de convocation précisera le lieu et la date de l'assemblée ainsi que les conditions requises pour y être admis. Il énoncera l'ordre du jour et fera référence aux exigences de la législation luxembourgeoise en matière de quorum et de majorité pour cette assemblée.

Rapports annuels et semestriels

Les Rapports annuels audités et Rapports semestriels non audités pourront être consultés aux sièges respectifs de la Société et de l'Agent administratif dans un délai respectif de quatre et deux mois après la fin de la période comptable visée et le dernier Rapport annuel sera mis à disposition au moins quinze jours avant la tenue de l'assemblée générale annuelle. L'exercice de la Société s'achève le 31 décembre de chaque année.

Publication des notifications

Toute évolution concernant votre investissement dans la Société ou ses Compartiments, à moins que d'autres moyens de communication ne soient spécifiés dans le Prospectus ou requis conformément aux lois et règlements applicables

au Luxembourg, sera notifiée par l'intermédiaire du site web <https://www.amundi.lu/retail/Shareholder-Notices/MultiUnitsLuxembourg> ou l'un quelconque de ses successeurs.

Nous vous invitons donc à consulter ce site internet régulièrement.

Documents pouvant être consultés

La copie des documents suivants peut être examinée gratuitement tous les jours de la semaine (excepté les samedis et jours fériés) pendant les heures de bureau normales au siège de la Société, 9, rue de Bitbourg, L-1273 Luxembourg :

1. les Statuts de la Société ;
2. les DIC ;
3. le dernier Rapport annuel certifié et le Rapport semestriel de la Société.

La copie des documents énumérés ci-dessus peut être remise sans frais aux investisseurs intéressés sur demande.

Une copie du plan d'urgence, au sens du règlement (UE) 2016/1011, concernant les indices utilisés comme indices de référence pour les instruments et les contrats financiers, ou pour mesurer la performance des fonds d'investissement, est disponible sur demande auprès de la Société de gestion.

Les déclarations figurant dans le présent Prospectus reposent sur la législation et les pratiques en vigueur dans le Grand-Duché du Luxembourg à la date du présent Prospectus et sont sujettes à modification en cas de changement affectant cette législation et ces pratiques.

ANNEXES

ANNEXE 1

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi DAX III

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi DAX III** consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du DAX® (l'« **Indice** »), tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

Deutsche Börse (fournisseur de l'Indice) est le principal fournisseur allemand d'indices sur actions.

Tous les indices sur actions de Deutsche Börse sont pondérés par la capitalisation boursière ; cependant, seules les actions librement négociables et disponibles (« flottant ») sont prises en compte. L'Indice décrit dans les présentes est construit et tenu à jour par Deutsche Börse conformément à cette méthodologie. Les Actionnaires peuvent obtenir des informations sur la méthodologie en se rendant sur le site Internet de Deutsche Börse à l'adresse www.deutsche-boerse.com.

Deutsche Börse prend ses décisions éditoriales au sujet de l'Indice indépendamment de toute partie.

Bien que les Administrateurs considèrent que la description suivante de l'Indice est correcte, elle repose sur des informations publiques obtenues auprès de Deutsche Börse et disponibles sur le site Internet de Deutsche Börse et n'a pas été avalisée par Deutsche Börse.

- **Objectifs de l'Indice**

Le DAX®, qui reflète le secteur des valeurs allemandes de premier ordre, se compose des sociétés cotées sur la Bourse de Francfort (FWB®) qui présentent la plus forte capitalisation boursière et y sont les plus activement négociées. Les 30 sociétés qui le composent ont été admises au segment de marché Prime Standard. Le DAX® a été conçu en tant que successeur du « Börsen-Zeitung Index », dont la série chronologique remonte à 1959.

- **Méthodologie de l'Indice**

Le DAX® est pondéré par capitalisation boursière, c'est-à-dire que le poids d'une valeur est fonction de sa part dans la capitalisation totale de l'indice.

Cependant, seules les actions négociables et disponibles sur le marché (le « flottant ») sont prises en compte. Par conséquent, la pondération de l'Indice dépend exclusivement de la part du capital qui est disponible sur le marché (le « flottant »). Le nombre d'actions d'une société du DAX® peut être plafonné afin d'éviter qu'elle n'ait un poids excessif dans l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

Il n'existe aucune garantie que la méthode de construction de l'Indice telle que décrite dans la section ci-dessus ne sera pas modifiée par Deutsche Börse. Dans le cas où elle subirait une modification notable, le Gestionnaire, avec l'accord des Administrateurs, pourra décider à sa discrétion de remplacer l'Indice par un autre indice adéquat si un tel indice existe à ce moment.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet <http://www.dax-indices.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres

OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA), ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux grandes valeurs allemandes.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE

NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,05 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, risque de perte en capital, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié au prêt de titres, Risque lié à la gestion des garanties, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Deutsche Börse AG (le « **Concédant de la Licence** ») ne promeut, ne distribue ni n'avalise le présent instrument financier de quelque manière que ce soit. Le Concédant de la Licence ne donne aucune garantie et s'abstient de toute déclaration, expresse ou tacite, à propos des résultats de l'utilisation de l'Indice et/ou de la Marque de l'Indice, à propos de la valeur de l'Indice à un moment donné ou à une date donnée, non plus qu'à tout autre égard. L'Indice est calculé et publié par Concédant de la Licence. Néanmoins, dans la mesure permise par la législation, le Concédant de la Licence ne pourra être tenu pour responsable envers des tiers d'éventuelles erreurs affectant l'Indice. En outre, le Concédant de la Licence n'est soumis à aucune obligation vis-à-vis de tiers, y compris les investisseurs, de signaler les erreurs susceptibles d'affecter l'Indice.

Ni la publication de l'Indice par le Concédant de la Licence, ni l'octroi d'une licence portant sur l'Indice et la

Marque de l'Indice en vue de son utilisation en relation avec les instruments financiers ou d'autres titres ou produits financiers dérivés de l'Indice n'ont valeur de recommandation d'un investissement par le Concédant de la Licence. Ils n'impliquent en aucune manière une garantie ou un avis dans le chef du Concédant de la Licence quant à l'opportunité d'un investissement dans ce produit.

En sa qualité de propriétaire exclusif de tous les droits sur l'Indice et la Marque de l'Indice, le Concédant de la Licence s'est limité à concéder à l'émetteur de l'instrument financier un droit d'utilisation de l'Indice et de la Marque de l'Indice ainsi que de toute référence à l'Indice et à la Marque de l'Indice en lien avec cet instrument financier.

ANNEXE 2

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi LevDax Daily (2x) leveraged

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi LevDax Daily (2x) leveraged** consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du LevDAX[®] (l'« **Indice** »), tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

Deutsche Börse (fournisseur de l'Indice) est le principal fournisseur allemand d'indices sur actions.

Tous les indices sur actions de Deutsche Börse sont pondérés par la capitalisation boursière ; cependant, seules les actions librement négociables et disponibles (« flottant ») sont prises en compte. L'Indice décrit dans les présentes est construit et tenu à jour par Deutsche Börse conformément à cette méthodologie. Les actionnaires peuvent obtenir des informations sur la méthodologie en se rendant sur le site Internet de Deutsche Börse à l'adresse www.deutsche-boerse.com.

Deutsche Börse prend ses décisions éditoriales au sujet de l'Indice indépendamment de toute partie.

Bien que les Administrateurs considèrent que la description suivante de l'Indice est correcte, elle repose sur des informations publiques obtenues auprès de Deutsche Börse et disponibles sur le site Internet de Deutsche Börse et n'a pas été avalisée par Deutsche Börse.

- **Objectifs de l'Indice**

Le LevDAX[®] procure une exposition quotidienne au DAX[®] en faisant appel à l'effet de levier. Le DAX[®], qui reflète le secteur des valeurs allemandes de premier ordre, se compose des sociétés cotées sur la Bourse de Francfort (FWB[®]) qui présentent la plus forte capitalisation boursière et y sont les plus activement négociées. Les 30 sociétés qui le composent ont été admises au segment de marché Prime Standard.

- **Méthodologie de l'Indice**

Grâce à l'effet de levier, le LevDAX[®] procure une exposition quotidienne de 200 % au DAX[®], dont il convient de retrancher les coûts de financement de l'effet de levier. La stratégie de recours à l'effet de levier sera appliquée au niveau de l'Indice.

L'effet de levier peut être réajusté en cours de séance si la valeur du DAX[®] baisse de 25 % au cours de la séance. Les ajustements intrajournaliers reposeront sur des cadres objectifs algorithmiques.

Le DAX[®] est pondéré par la capitalisation boursière, c'est-à-dire que le poids d'une valeur est fonction de sa part dans la capitalisation totale du DAX[®]. Cependant, seules les actions négociables et disponibles sur le marché (le « flottant ») sont prises en compte. Par conséquent, la pondération du DAX[®] dépend exclusivement de la part du capital qui est disponible sur le marché (le « flottant »). Le nombre d'actions d'une société du DAX[®] peut être plafonné afin d'éviter qu'elle n'ait un poids excessif dans le DAX[®].

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels.

Les opérations de rééquilibrage effectuées selon la fréquence décrite ci-dessus pourraient se solder par une augmentation des coûts payés ou encourus par le Compartiment et, par conséquent, nuire à ses performances.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet <http://www.dax-indices.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de son actif dans des unités, parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans des OPC ne sera effectué.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux grandes valeurs allemandes.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE A – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, risque de perte en capital, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié au prêt de titres, Risque lié à la gestion des garanties, Risque lié au calcul de l'Indice.

En outre, le Compartiment est exposé au risque suivant :

Risques encourus du fait du réajustement quotidien de l'effet de levier : les investisseurs sont doublement exposés aux fluctuations qui affectent le cours ou le niveau de l'Indice parent de jour en jour. En particulier, toute perte de valeur sur le marché sous-jacent sera amplifiée et entraînera une dépréciation encore plus forte de la valeur liquidative du Compartiment. Le réajustement quotidien de la formule de l'indice de la stratégie sous-jacente « à effet de levier » signifie que, pendant une durée de plusieurs jours de négociation, les performances du Compartiment ne seront pas égales au double de celles de l'Indice parent.

Par exemple, si l'Indice parent augmente de 10 % au cours d'un jour de négociation donné avant de baisser de 5 % le jour suivant, l'ETF aura augmenté de 8 % au total à l'issue de ces deux jours (avant déduction des commissions applicables), tandis que l'Indice parent aura augmenté de 4,5 % sur cette même période.

Si l'Indice parent baisse de 5 % au cours de deux jours de négociation consécutifs, il aura perdu au total 9,75 %, tandis que l'ETF aura perdu 19 % sur

la même période (avant déduction des commissions applicables).

Cas de hausse défavorable

	Indice parent	Indice de référence	Effet de levier engendré
Performance le Jour 1	+ 10 %	+ 20 %	x2
Performance le Jour 2	- 5 %	- 10 %	x2
Performance totale sur la période	+4,5 %	+8 %	x1,78

Cas de hausse favorable

	Indice parent	Indice de référence	Effet de levier engendré
Performance le Jour 1	- 5 %	- 10 %	x2
Performance le Jour 2	- 5 %	- 10 %	x2
Performance totale sur la période	- 9,75 %	-19 %	x1,95

En outre, il peut arriver que, au cours d'une période d'observation supérieure à un jour et en cas de forte volatilité de l'Indice parent durant cette période, la valeur liquidative du Compartiment baisse même si l'Indice parent est en hausse sur cette même période.

Exemple d'effet de levier inversé :

	Indice parent	Indice de référence			Effet de levier engendré
		Performance le Jour i	Valeur le Jour i	Valeur le Jour i	
		100		100	
Jour 1	20 %	120	40 %	140	x2
Jour 2	-20 %	96	-40 %	84	x2
Jour 3	30 %	124,8	60 %	134,4	x2
Jour 4	-20 %	99,84	-40 %	80,64	x2
Jour 5	10 %	109,824	20 %	96,768	x2
Total sur la période	+ 9,82 %		- 3,23 %		x -0,33

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le

Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Deutsche Börse AG (le « **Concédant de la Licence** ») ne promeut, ne distribue ni n'avalise le présent instrument financier de quelque manière que ce soit. Le Concédant de la Licence ne donne aucune garantie et s'abstient de toute déclaration, expresse ou tacite, à propos des résultats de l'utilisation de l'Indice et/ou de la Marque de l'Indice, à propos de la valeur de l'Indice à un moment donné ou à une date donnée, non plus qu'à tout autre égard. L'Indice est calculé et publié par Concédant de la Licence. Néanmoins, dans la mesure permise par la législation, le Concédant de la Licence ne pourra être tenu pour responsable envers des tiers d'éventuelles erreurs affectant l'Indice. En outre, le Concédant de la Licence n'est soumis à aucune obligation vis-à-vis de tiers, y compris les investisseurs, de signaler les erreurs susceptibles d'affecter l'Indice.

Ni la publication de l'Indice par le Concédant de la Licence ni l'octroi d'une licence portant sur l'Indice ainsi que la Marque de l'Indice en vue de son utilisation en relation avec les instruments financiers ou autres titres ou produits financiers dérivés de l'Indice n'a valeur de recommandation d'un investissement par le Concédant de la Licence et ils n'impliquent en aucune manière une garantie ou un avis du Concédant de la Licence quant à l'opportunité d'un investissement dans ce produit.

En sa qualité de propriétaire exclusif de tous les droits sur l'Indice et la Marque de l'Indice, le Concédant de la Licence s'est limité à concéder à l'émetteur de l'instrument financier un droit d'utilisation de l'Indice et de la Marque de l'Indice ainsi que de toute référence à l'Indice et à la Marque de l'Indice en lien avec cet instrument financier.

ANNEXE 3

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 II

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 II** consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du S&P 500[®] Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Daily Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie quotidienne de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

Le S&P 500 Net Total Return est un indice pondéré par le flottant, publié depuis 1957. Il décrit l'évolution du cours des actions ordinaires de 500 valeurs à forte capitalisation boursière activement négociées aux États-Unis. Les actions incluses dans le S&P 500 Net Total Return sont celles de grandes sociétés cotées sur l'une des deux plus grandes bourses américaines (le NYSE et le NASDAQ OMX).

- **Méthodologie de l'Indice**

Le Comité de l'Indice S&P actualise sa composition en suivant un ensemble de règles publiques. Des explications exhaustives sur ces règles, y compris les critères d'inclusion dans l'indice et de retrait de celui-ci, les déclarations de politique et les documents de recherche sont disponibles sur le site Internet www.indices.standardandpoors.com.

CRITÈRES D'INCLUSION DANS L'INDICE

- **Solidité financière.** Les sociétés doivent avoir publié des résultats positifs pendant quatre trimestres d'affilée, le bénéfice déclaré étant défini comme le résultat net au sens des GAAP

hors activités interrompues et éléments extraordinaires.

- Liquidité adéquate et prix raisonnable.

- **Représentation sectorielle :** les classements des entreprises par secteur contribuent à préserver un équilibre sectoriel conforme à la composition de l'univers des sociétés éligibles dont la capitalisation boursière est supérieure à 3,5 milliards USD.

- **Type de sociétés :** les sociétés faisant partie de l'indice doivent être des sociétés d'exploitation. Les sociétés d'investissement à capital fixe, les holdings, les sociétés de personnes, les véhicules d'investissement et les fiducies gérant des redevances ne sont pas éligibles. Le Comité de l'Indice s'efforce de limiter les mouvements superflus dans la composition de l'indice, si bien que chaque retrait est décidé au cas par cas.

CRITÈRES DE RETRAIT DE L'INDICE

- Écart important d'une société par rapport à un ou plusieurs critères d'inclusion dans l'Indice.

- Participation d'une société à une fusion, une acquisition ou une restructuration significative de telle sorte qu'elle ne remplisse plus les critères d'inclusion dans l'Indice.

La composition de l'Indice est révisée et repondérée tous les trimestres ou, dans certains cas précis tels que décrits de façon plus détaillée dans la méthodologie de l'Indice, à une date anticipée fixée par le promoteur de l'Indice.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur <http://www.spindices.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Conformément à l'objectif et à la politique d'investissement décrits ci-dessus, le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent avoir une exposition aux cours des actions ordinaires des 500 valeurs à forte capitalisation activement négociées aux États-Unis.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

Afin de couvrir certains frais du Compartiment (pouvant inclure, notamment, les commissions du Gestionnaire de placements, de l'Agent administratif et de l'Agent dépositaire, ainsi que des coûts relatifs aux Licences d'utilisation d'indices), la Société de gestion peut requérir une contribution sous forme de commission aux contreparties à des transactions sur instruments dérivés et/ou des instruments participant à la réalisation de la Réplication indirecte (des informations supplémentaires sont disponibles sur www.amundiETF.com, ou sur demande auprès de www.amundi.com – « Contact Us »).

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. En conséquence, toutes ses Actions, à l'exception des Actions DI – USD, seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation auprès d'au moins un teneur de marché qui prendra des mesures pour faire en sorte que le cours de bourse des Actions ne s'écarte pas sensiblement de leur Valeur liquidative indicative (VLI) telle qu'elle est définie plus haut.

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,50 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLI des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une Classe, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des

investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par Standard & Poor's et ses sociétés affiliées (« S&P »). S&P s'abstient de toute déclaration et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires du fonds ou à un quelconque membre du public quant à l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le fonds en particulier ou quant à la capacité de l'Indice S&P 500 Net Total Return de reproduire la performance de certains marchés financiers et/ou compartiments de ceux-ci et/ou groupes ou classes d'actifs. La seule relation entre S&P et Amundi Asset Management consiste en l'octroi de licences sur certaines marques et appellations commerciales, ainsi que sur l'Indice S&P 500 qui est compilé, composé et calculé par S&P sans égard pour Amundi Asset Management ou le compartiment. S&P n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins d'Amundi Asset Management ou des propriétaires du compartiment en compilant, composant ou calculant l'Indice S&P 500 Net Total Return. S&P ne peut être tenu pour responsable de et n'a pas participé à la détermination des prix et des volumes du compartiment, non plus qu'à la fixation de la date de l'émission ou de la vente du compartiment ou à la détermination ou au calcul de l'équation régissant la conversion des parts du compartiment en espèces. S&P n'a aucune obligation ou responsabilité quant à l'administration, la commercialisation ou la négociation du compartiment.

S&P ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité du S&P 500 Net Total Return Index ni des données qui y sont incluses. S&P ne saurait être tenu responsable d'erreurs, d'omissions ou d'interruptions de l'indice. S&P ne donne, de manière expresse ou implicite, aucune garantie, ne conditionne pas et ne fait aucune déclaration quant aux résultats à obtenir par Amundi Asset Management, les propriétaires du compartiment ou toute autre personne ou entité, en utilisant le S&P 500 Net Total Return Index ou les données qui y sont incluses. Sans préjudice

de ce qui précède, S&P ne pourra en aucun cas être tenu pour responsable d'un quelconque préjudice du fait de dommages et intérêts spéciaux, indirects ou pour préjudice moral, ou de dommages et intérêts indirects (y compris pour un manque à gagner) résultant de l'utilisation de l'Indice S&P 500 Net Total Return ou d'une quelconque donnée incorporée dans celui-ci, même s'il a été avisé de la possibilité de tels dommages.

ANNEXE 4

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Australia S&P/ASX 200

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Australia S&P /ASX 200** consiste à suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice S&P/ASX 200 Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollars australiens (AUD), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Erreur de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Daily Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie quotidienne de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

Le S&P ASX 200 Net Total Return mesure la performance des 200 plus grandes valeurs éligibles cotées sur l'ASX selon le critère de la capitalisation boursière corrigée du flottant. Cet indice est corrigé du flottant et couvre approximativement 80 % de la capitalisation boursière des actions australiennes cotées.

Les composantes de l'indice S&P ASX 200 Net Total Return sont repondérées tous les trimestres afin de garantir une liquidité et une capitalisation du marché appropriées.

L'indice S&P/ASX 200 Net Total Return est compilé par le Comité de l'Indice australien S&P, dans lequel siègent des économistes et analystes indiciaires de Standard & Poor's et des représentants de l'Australian Securities Exchange (ASX).

- **Méthodologie de l'Indice**

Le Comité australien de l'Indice S&P actualise sa composition en suivant un ensemble de règles publiques. Des explications exhaustives sur ces règles, y compris les critères d'inclusion dans l'indice et de retrait de celui-ci, les déclarations de politique et les documents de recherche sont

disponibles sur le site Internet www.indices.standardandpoors.com.

Le Comité de l'Indice révisé sa composition tous les trimestres afin de garantir une liquidité et une capitalisation boursière appropriées.

Les révisions trimestrielles ont lieu le troisième vendredi des mois de décembre, mars, juin et septembre.

La pondération des composantes du S&P/ASX 200 Net Total Return est fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant qui est assignée à chaque titre par le Comité de l'Indice. La correction du flottant de chaque composante de l'Indice est révisée dans le cadre de la révision trimestrielle de mars.

CRITÈRES D'INCLUSION DANS L'INDICE

- **Cotation** : seules les valeurs cotées sur l'Australian Securities Exchange peuvent être incluses dans l'un quelconque des indices S&P/ASX.
- **Capitalisation boursière** : les sociétés sont évaluées sur la base de leur capitalisation boursière moyenne corrigée du flottant telle qu'elle s'établit en fin de séance sur les 6 mois précédents.
- **Flottant** : le flottant doit représenter au moins 30 % des actions en circulation pour qu'une valeur soit incluse dans les indices S&P/ASX.
- **Liquidité** : seuls les titres activement négociés et faisant l'objet de transactions régulières sont éligibles à un quelconque indice S&P/ASX.

Le Comité de l'Indice s'efforce de limiter les mouvements superflus dans la composition de l'indice, si bien que chaque retrait est décidé au cas par cas.

CRITÈRES DE RETRAIT DE L'INDICE

- **Écart important d'une société par rapport à un ou plusieurs critères d'inclusion dans l'Indice.**
- **Participation d'une société à une fusion, une acquisition ou une restructuration significative de telle sorte qu'elle ne remplisse plus les critères d'inclusion dans l'Indice.**

La composition de l'Indice est révisée et repondérée tous les trimestres ou, dans certains cas précis tels que décrits de façon plus détaillée dans la méthodologie de l'Indice, à une date anticipée fixée par le promoteur de l'Indice.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles

de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.spindices.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplcation indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Conformément à l'objectif et à la politique d'investissement décrits ci-dessus, le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux 200 plus grandes valeurs éligibles à l'Indice qui sont cotées sur l'ASX selon le critère de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories

d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur <http://www.amundiETF.com>.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une Classe, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par Standard & Poor's et ses sociétés affiliées (« S&P »). S&P s'abstient de toute déclaration ou condition et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires du fonds ou à un quelconque membre du public quant à l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le fonds en particulier ou quant à la capacité de l'Indice S&P ASX 200 Net Total Return de reproduire la performance de certains marchés financiers et/ou compartiments de ceux-ci et/ou groupes ou classes d'actifs. Le seul lien entre S&P et Amundi Asset Management consiste en l'octroi de licences sur certaines marques et appellations commerciales ainsi que sur l'indice S&P ASX 200 Net Total Return qui est compilé, composé et calculé par S&P sans égard pour Amundi Asset Management et pour le fonds. S&P n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins de Amundi Asset Management ou des propriétaires du fonds lorsqu'il compile, compose ou calcule l'Indice S&P ASX 200 Net Total Return. S&P ne peut être tenu pour responsable de et n'a pas participé à la détermination des prix et des volumes du compartiment, non plus qu'à la fixation de la date de l'émission ou de la vente du compartiment ou à la détermination ou au calcul de l'équation régissant la conversion des parts du compartiment en espèces. S&P n'a aucune obligation ou responsabilité quant à l'administration, la commercialisation ou la négociation du compartiment.

S&P ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice S&P ASX 200 Net Total Return, non plus que d'une quelconque donnée qu'il intègre, et S&P décline toute responsabilité quant à toute erreur, omission ou interruption

affectant cet Indice. S&P s'abstient de toute déclaration ou condition et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires du fonds ou à une quelconque autre personne physique ou morale, quant aux résultats que Amundi Asset Management retirera de l'utilisation de l'Indice S&P ASX 200 Net Total Return ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. Sans préjudice de ce qui précède, S&P ne pourra en aucun cas être tenu pour responsable d'un quelconque préjudice du fait de dommages et intérêts spéciaux, indirects ou pour préjudice moral, ou de dommages et intérêts indirects (y compris pour un manque à gagner) résultant de l'utilisation de l'Indice S&P ASX 200 Net Total Return ou d'une quelconque donnée incorporée dans celui-ci, même s'il a été avisé de la possibilité de tels dommages.

ANNEXE 5

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Information Technology

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Information Technology** consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du MSCI World Information Technology Index – Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant qui est conçu pour mesurer la performance de l'univers d'investissement composé de sociétés des technologies de l'information cotées en bourse selon la classification du Global Industry Classification Standard (GICS®). Il est conçu de manière à englober les titres de sociétés à moyenne comme à forte capitalisation. Au 20 avril 2010, l'Indice comprenait 148 sociétés de 24 pays.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices, qui prend en compte la taille, la liquidité et le flottant minimal requis pour les valeurs faisant partie de l'univers d'investissement.

La méthodologie complète de l'Indice (y compris sa conservation et son rééquilibrage) peut être consultée sur le site Internet de MSCI : www.msibarra.com.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une répllication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent être exposés à la performance des principales sociétés des technologies de l'information dans le monde.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles.

Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI, par une quelconque autre filiale de MSCI ou par l'une quelconque des autres entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par le Gestionnaire. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs d'Actions du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation d'actions de fonds en général ou d'actions de ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec le Gestionnaire ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins du Gestionnaire ou des porteurs d'Actions du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité d'Actions du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou

d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

BIEN QUE MSCI OBTIENNE DES DONNÉES INTÉGRÉES OU UTILISÉES DANS LE CALCUL DES INDICES PROVENANT DE SOURCES QUE MSCI ESTIME FIABLES, NI MSCI, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION OU LE CALCUL DES INDICES MSCI NE GARANTIT L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INTÉGRÉE.

NI MSCI NI AUCUNE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION OU LE CALCUL DES INDICES MSCI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, CONCERNANT LES RÉSULTATS INDIQUANT QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE MSCI, LES CLIENTS DUDIT TITULAIRE DE LICENCE, LES CONTREPARTIES, LES PORTEURS DE PARTS DU FONDS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ OBTIENDRONT À LA SUITE DE L'UTILISATION DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INTÉGRÉE EN RELATION AVEC LES DROITS CONCÉDÉS OU À TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI NI AUCUNE AUTRE PARTIE NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI DÉCLINE TOUTE GARANTIE CONCERNANT LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UNE FIN SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DONNÉES INTÉGRÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS LA RESPONSABILITÉ DE MSCI OU DE TOUTE AUTRE PARTIE NE SERA ENGAGÉE POUR DE QUELCONQUES DOMMAGES QUE CEUX-CI SOIENT DIRECTS, INDIRECTS OU AUTRE (Y COMPRIS LA PERTE DE RÉSULTATS) MÊME EN CAS DE CONNAISSANCE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 6

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Health Care

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Health Care** consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du MSCI World Health Care Index – Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

• **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant qui est conçu pour mesurer la performance de l'univers d'investissement composé de sociétés de soins de santé du monde entier qui sont cotées en bourse selon la classification du Global Industry Classification Standard (GICS®). Il est conçu de manière à englober les titres de sociétés à moyenne comme à forte capitalisation. Au 20 avril 2010, l'Indice comprenait 119 sociétés de 24 pays.

• **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices, qui prend en compte la taille, la liquidité et le flottant minimal requis pour les valeurs faisant partie de l'univers d'investissement.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : www.msциbarra.com.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

• **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent être exposés à la performance des principales sociétés des soins de santé dans le monde.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas

l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI, par une quelconque autre filiale de MSCI ou par l'une quelconque des autres entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par le Gestionnaire. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs d'Actions du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation d'actions de fonds en général ou d'actions de ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec le Gestionnaire ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins du Gestionnaire ou des porteurs d'Actions du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité d'Actions du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

BIEN QUE MSCI OBTIENNE DES DONNÉES INTÉGRÉES OU UTILISÉES DANS LE CALCUL

DES INDICES PROVENANT DE SOURCES QUE MSCI ESTIME FIABLES, NI MSCI, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION OU LE CALCUL DES INDICES MSCI NE GARANTIT L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INTÉGRÉE. NI MSCI NI AUCUNE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION OU LE CALCUL DES INDICES MSCI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, CONCERNANT LES RÉSULTATS INDIQUANT QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE MSCI, LES CLIENTS DUDIT TITULAIRE DE LICENCE, LES CONTREPARTIES, LES PORTEURS DE PARTS DU FONDS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ OBTIENDRONT À LA SUITE DE L'UTILISATION DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INTÉGRÉE EN RELATION AVEC LES DROITS CONCÉDÉS OU À TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI NI AUCUNE AUTRE PARTIE NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI DÉCLINE TOUTE GARANTIE CONCERNANT LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UNE FIN SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DONNÉES INTÉGRÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS LA RESPONSABILITÉ DE MSCI OU DE TOUTE AUTRE PARTIE NE SERA ENGAGÉE POUR DE QUELCONQUES DOMMAGES QUE CEUX-CI SOIENT DIRECTS, INDIRECTS OU AUTRE (Y COMPRIS LA PERTE DE RÉSULTATS) MÊME EN CAS DE CONNAISSANCE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 7

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Financials

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World Financials** consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du MSCI World Financials Index – Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant qui est conçu pour mesurer la performance de l'univers d'investissement composé de sociétés financières du monde entier qui sont cotées en bourse selon la classification du Global Industry Classification Standard (GICS®). Il est conçu de manière à englober les titres de sociétés à moyenne comme à forte capitalisation. Au 20 avril 2010, l'Indice comprenait 338 sociétés de 24 pays.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices, qui prend en compte la taille, la liquidité et le flottant minimal requis pour les valeurs faisant partie de l'univers d'investissement.

La méthodologie complète de l'Indice (y compris sa conservation et son rééquilibrage) peut être consultée sur le site Internet de MSCI : www.msccibarra.com.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux grandes valeurs financières du monde entier.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiief.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas

l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI, par une quelconque autre filiale de MSCI ou par l'une quelconque des autres entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par le Gestionnaire. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs d'Actions du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation d'actions de fonds en général ou d'actions de ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec le Gestionnaire ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité d'Actions du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

BIEN QUE MSCI OBTIENNE DES DONNÉES INTÉGRÉES OU UTILISÉES DANS LE CALCUL DES INDICES PROVENANT DE SOURCES QUE MSCI ESTIME FIABLES, NI MSCI, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION OU LE CALCUL DES INDICES MSCI NE GARANTIT L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INTÉGRÉE. NI MSCI NI AUCUNE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION OU LE CALCUL DES INDICES MSCI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, CONCERNANT LES RÉSULTATS INDICANT QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE MSCI, LES CLIENTS DUDIT TITULAIRE DE LICENCE, LES CONTREPARTIES, LES PORTEURS DE PARTS DU FONDS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ OBTIENDRONT À LA SUITE DE L'UTILISATION DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INTÉGRÉE EN RELATION AVEC LES DROITS CONCÉDÉS OU À TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI NI AUCUNE AUTRE PARTIE NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI DÉCLINE TOUTE GARANTIE CONCERNANT LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UNE FIN SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DONNÉES INTÉGRÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS LA RESPONSABILITÉ DE MSCI OU DE TOUTE AUTRE PARTIE NE SERA ENGAGÉE POUR DE QUELCONQUES DOMMAGES QUE CEUX-CI SOIENT DIRECTS, INDIRECTS OU AUTRE (Y COMPRIS LA PERTE DE RÉSULTATS) MÊME EN CAS DE CONNAISSANCE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 8

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll** consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll Index (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice procure une exposition vendeuse variable, tant positive que négative, aux fluctuations du marché des contrats à terme standardisés, tels qu'échangés sur le Chicago Board Options Exchange, liées à la volatilité implicite de l'indice S&P 500.

Cet indice procure également une exposition au marché monétaire américain, compte tenu de l'absence de financement pour mettre en œuvre la stratégie.

L'indice S&P 500, libellé en dollars des États-Unis, comprend les titres de 500 grandes sociétés américaines.

Cet Indice est calculé en temps réel et publié sur le site Internet de S&P : www.standardandpoors.com.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'indice procure la performance d'un panier de contrats à terme standardisés à court terme (échéances de 1 à 2 mois) et à moyen terme (échéances de 3 à 5 mois) sur l'indice VIX, majoré du rendement cumulatif des taux d'intérêt des bons du Trésor américain (bons du Trésor à 3 mois). Afin d'optimiser la performance de l'Indice, le panier inclut des contrats à terme standardisés à moyen terme au cours des périodes calmes et des contrats court terme lorsque les marchés sont très agités. Le transfert d'un panier vers un autre est déterminé, en vertu de la méthode de construction de l'Indice, par des signaux fondés sur la valeur de l'indice VIX par rapport à sa moyenne mobile.

La performance suivie est celle de la valeur de l'Indice à 15 h 15 heure de Chicago (GMT-6), libellé en dollars des États-Unis (USD).

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction sont disponibles sur le site Internet : www.standardandpoors.com.

La performance reproduite est mesurée à la clôture de la cotation de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels ou, dans certains cas précis décrits de façon plus détaillée dans la méthodologie de l'Indice, à une date anticipée fixée par le promoteur de l'Indice.

Les opérations de rééquilibrage effectuées selon la fréquence décrite ci-dessus pourraient se solder par une augmentation des coûts payés ou encourus par le Compartiment et, par conséquent, nuire à ses performances.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur <http://www.spindices.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à la volatilité implicite de l'indice S&P 500.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,50 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de perte en capital, risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risques liés aux investissements dans des contrats à terme standardisés sur l'indice VIX, Risque lié au calcul de l'Indice.

- **Risque de marché lié à la volatilité implicite de l'indice S&P 500 :**

Le Compartiment est entièrement exposé aux fluctuations de l'Indice. Il est donc exposé à l'intégralité des risques de marché liés aux variations résultant de la volatilité implicite des titres qui composent l'indice S&P 500. En particulier, les investisseurs sont exposés à une diminution progressive de la volatilité dans les années à venir.

- **Risque découlant du renouvellement des contrats à terme standardisés utilisés par les Compartiments :**

Étant donné que l'Indice est composé de contrats à terme standardisés sur l'indice de volatilité VIX, l'exposition à l'Indice est maintenue en reconduisant quotidiennement les positions sur ces contrats. Ce report consiste à transférer une position sur un contrat arrivant à échéance, avant que celle-ci ne soit atteinte, sur des contrats d'échéance plus éloignée. Le Compartiment est exposé à un risque résultant du renouvellement de ces contrats. Sous certaines conditions de marché, ce phénomène peut entraîner une perte systématique à l'occasion du renouvellement quotidien de ces contrats. En conséquence, l'écart de performance entre le Compartiment et les contrats sous-jacents est susceptible d'augmenter progressivement dans un sens défavorable et de nuire à la performance du Compartiment, notamment lorsqu'un investissement à long terme y est réalisé.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De

plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni agréé, ni recommandé, ni vendu par Standard & Poor's ou ses filiales (« **S&P** »), ni par le Chicago Board Options Exchange Inc. (« **CBOE** ») ; S&P et CBOE s'abstiennent de toute déclaration et ne donnent aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, aux actionnaires du Compartiment ou à toute personne du public quant à l'opportunité d'un investissement dans des titres en général ou dans le Compartiment particulier, ou quant à la capacité de l'indice S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll à reproduire le rendement de certains marchés financiers et/ou de sections de ces marchés et/ou de groupes et/ou de catégories d'actifs. Le seul lien entre S&P, CBOE et Amundi Asset Management consiste en l'octroi de licences sur certaines marques et appellations commerciales ainsi que sur l'indice S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll qui est compilé, composé et calculé par S&P, sans égard pour Amundi Asset Management ou pour le Compartiment. S&P n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins de Amundi Asset Management ou des actionnaires du Compartiment lorsqu'il compile, compose ou calcule l'Indice S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll. S&P et CBOE ne peuvent être tenus pour responsable de, et n'ont pas participé à, la détermination des prix et des quantités du Compartiment non plus qu'à la fixation de la date de l'émission ou de la vente d'actions des Compartiments ou à la détermination ou au calcul de l'équation régissant la conversion des actions des Compartiments en liquidités. S&P n'est soumis à aucune obligation d'assurer l'administration, la commercialisation ou la négociation du Compartiment.

S&P et CBOE ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'indice S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll VIX ou de toute donnée incorporée dans celui-ci et ne pourront être tenus pour responsables de toute erreur, omission ou interruption affectant cet Indice. S&P et CBOE s'abstiennent de toute déclaration ou ne donnent aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, quant aux résultats que Amundi Asset Management, les actionnaires du Compartiment ou toute autre personne ou entité retireront de

l'utilisation de l'indice S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll et des données incorporées dans celui-ci. S&P et CBOE s'abstiennent de toute déclaration ou ne donnent aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, et déclinent expressément toute garantie, quant à la qualité marchande ou l'adéquation à un usage donné ou une finalité particulière ainsi que tout autre garantie ou condition, explicite ou implicite, concernant l'indice S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll et les données incorporées dans celui-ci. Sans préjudice de ce qui précède, S&P et CBOE ne pourront être tenus pour responsables d'un quelconque préjudice du fait de dommages et intérêts spéciaux, indirects ou pour préjudice moral, ou de dommages et intérêts indirects (y compris pour un manque à gagner) résultant de l'utilisation de l'indice S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll ou de toute autre donnée incorporée dans celui-ci, même s'ils ont été avisés de la possibilité de tels dommages.

ANNEXE 9

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Equity Quality Income

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Equity Quality Income** est de reproduire la performance, sans effet de levier, de l'indice « SG Global Quality Income NTR » (l'« **Indice** ») libellé en euros (EUR), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'indice SG Global Quality Income NTR est formé par des sociétés distribuant des dividendes durablement élevés.

L'Indice est conçu par Société Générale Research selon une méthode exclusive.

L'Indice est calculé par Solactive A.G. et publié par Stuttgart Boerse A.G.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice suit des sociétés distribuant des dividendes durablement élevés car, à long terme, les performances des actions ont dépendu principalement des dividendes, tandis que l'acceptation d'un risque plus élevé n'a pas été récompensée par des gains supplémentaires.

De ce point de vue, la méthode de construction de l'Indice définit un univers d'investissement formé par des sociétés non financières dont la capitalisation boursière ajustée du flottant s'élève au moins à 3 milliards de dollars américains, de pays développés tels qu'ils sont énoncés ci-dessous : Australie, Allemagne,

Autriche, Belgique, Canada, Corée du Sud, Danemark, Espagne, États-Unis, Finlande, France, Grèce, Hong Kong, Irlande, Israël, Italie, Japon, Luxembourg, Norvège, Nouvelle-Zélande, Pays-Bas, Portugal, Royaume-Uni, Singapour, Suède et Suisse.

Un algorithme est ensuite appliqué à l'univers d'investissement ci-dessus. Cet algorithme applique les trois filtres ci-après :

- une note de qualité (définie comme la somme de 9 critères reposant sur la rentabilité, l'endettement et la rentabilité d'exploitation de l'émetteur au regard d'indicateurs tels que le ROA, les flux de trésorerie etc.) au moins égale à 7 sur 9 ;
- une note de risque bilanciel mesurée en calculant la distance à la valeur correspondant à un défaut de paiement au regard de laquelle une société figure dans les 40 % de sociétés les plus performantes de l'indice ;
- une note de dividendes prévisionnels déterminée à la lumière du consensus des analystes. Seules sont maintenues les valeurs dont le dividende prévu dépasse le maximum de 4 % et 125 % de la moyenne de l'univers.

Le processus établi dans la méthode de construction de l'Indice se base sur un critère quantitatif et les sources utilisées dans le contexte de ce processus sont indépendantes, notamment les rapports annuels et les prévisions des dividendes du consensus Factset. Ces données font l'objet d'un contrôle de qualité en vue d'être incluses dans l'algorithme.

Tous les titres remplissant les critères ci-dessus sont maintenus dans l'indice. Ils ont tous la même pondération. Le nombre de titres sélectionnés doit être compris entre 75 et 125. Si l'application de la méthode ci-dessus aboutit à une sélection de moins de 75 (ou plus de 125) titres, les seuils des filtres sont revus de manière à être moins sévères (ou au contraire plus stricts) jusqu'à ce que le panier comprenne 75 (ou 125) titres.

L'Indice avait une base 1000 au 14 mai 2012. Il est repondéré chaque trimestre sur 5 jours ouvrés, le 7e jour ouvré de janvier, avril, juillet et octobre.

Des renseignements supplémentaires sur la méthode de construction de l'Indice sont disponibles sur le site Internet de Solactive.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

• Informations complémentaires sur l'Indice

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur <http://www.solactive.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux marchés d'actions des pays développés du monde entier.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES

ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de

change d'une Classe, Risque lié au calcul de l'Indice.

trouve l'Indice à une date donnée, non plus qu'à un autre sujet.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

L'Indice est la propriété exclusive du Promoteur.

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment ne bénéficie en aucune façon de la garantie, du soutien ou d'une action de promotion de, et n'est pas vendu par, Société Générale (le « Promoteur »).

Le Promoteur n'accorde aucune garantie, expresse ou tacite, quant (i) au caractère marchand ou à l'adéquation de l'Indice pour un but donné et (ii) aux résultats de l'utilisation de l'Indice et des données qui y sont incorporées.

Le Promoteur ne pourra être tenu pour responsable d'aucun dommage, coût, perte ou dépense (y compris un manque à gagner) naissant directement ou indirectement de l'utilisation de l'Indice ou d'une quelconque donnée qui y est incorporée. Le niveau de l'Indice ne représente ni une évaluation, ni le prix d'un quelconque produit référant cet Indice.

Le Promoteur ne donne aucune assurance au sujet d'un quelconque changement ou modification d'une quelconque méthode servant au calcul de l'Indice et n'est nullement tenu de continuer à calculer, publier et diffuser l'Indice.

Ce Compartiment n'est en aucune façon garanti, recommandé ou promu par Solactive AG. Solactive AG ne fait aucune déclaration et n'accorde aucune garantie de quelque sorte que ce soit, expresse ou tacite, ni au sujet des résultats qui seront obtenus en utilisant l'Indice, ni au sujet du chiffre indiquant le niveau où se

ANNEXE 10

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrat ESG

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrat ESG** est de reproduire la performance, sans effet de levier, de l'indice S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return Index (l'« **Indice** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'Actions Monthly Hedged mentionnées dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment aura également recours à une stratégie de couverture de change mensuelle, afin de réduire l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est conçu pour mesurer la performance de 40 sociétés au rendement spéculatif et bénéficiant d'une notation ESG du S&P Europe BMI (l'« **Indice parent** »), avec une classification par pays de la zone euro, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus. L'Indice parent est représentatif du marché d'actions européen.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être

consultée sur site Internet de S&P à l'adresse suivante : <http://www.spglobal.com>.

L'indice est repondéré sur une base annuelle après la clôture du troisième vendredi de juin.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.spglobal.com>

Pour de plus amples informations concernant l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par des compartiments indiciels » de la Section I « Objectifs d'investissement / Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements », qui figure dans la partie principale du présent Prospectus, ainsi qu'à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT SUR LES INDICES DE RÉFÉRENCE.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la

section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux marchés d'actions de la zone euro, émises par des sociétés à dividendes élevés ayant un score environnemental, social et de gouvernance (ESG) solide.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte

pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations complémentaires sur la VLi des actions négociées en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque lié au prêt de titres, risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur les Indices Dow Jones S&P en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation S&P DJI ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment.

Pour plus d'informations sur la méthodologie de notation ESG S&P DJI, veuillez consulter le site : <http://www.spglobal.com>. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni commandité, ni approuvé, ni vendu, ni recommandé par Standard & Poor's ou ses filiales (« **S&P** »). S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, aux actionnaires des Compartiments ou à tout membre du public concernant les opportunités d'investissement en valeurs mobilières en général ou dans un compartiment particulier, ou concernant les capacités de S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return Index à suivre le rendement de certains marchés financiers et/ou de sections de ceux-ci et/ou de groupes ou catégories d'actifs. Le seul lien entre S&P et Amundi Asset Management est l'octroi de licences pour certaines marques déposées ou marques commerciales et pour l'indice S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return qui est défini, composé et calculé par S&P, sans sans tenir compte d'Amundi Asset Management ni du Compartiment. L'agence S&P n'est pas tenue de prendre en compte les besoins d'Amundi Asset Management ou des actionnaires du Compartiment lors de la définition de la composition ou du calcul de l'indice S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return. S&P n'est pas responsable et n'a pas été partie à la définition des prix et des montants du Compartiment ou au calendrier d'émission ou de vente des Compartiments ou à la définition ou au calcul de l'équation de conversion des actions des Compartiments en actifs liquides. S&P n'a aucune obligation ou responsabilité en termes d'administration ou de commercialisation du Compartiment.

S&P ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'indice S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return ou des données qu'il contient et ne sera pas responsable de toute erreur, omission ou interruption s'y rapportant. S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, concernant les résultats qui seront obtenus par Amundi Asset Management, les actionnaires du Compartiment ou toute autre personne ou entité utilisant l'indice S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return ou toute donnée contenue dans celui-ci. S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, et décline expressément toute garantie, condition de qualité de marché ou adéquation à

un objectif ou à un usage spécifique ainsi que toute autre garantie ou condition, explicite ou implicite, relative à l'indice S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return ou à toute donnée qu'il contient. Sans préjudice de ce qui précède, S&P ne sera pas responsable de tout dommage spécial, punitif, indirect ou consécutif (y compris la perte de profits) résultant de l'utilisation de l'indice S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return ou de toute autre donnée qu'il contient, même si elle a été avertie de la possibilité que ledit dommage puisse se produire.

ANNEXE 11

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Pacific Ex Japan

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Pacific Ex Japan** consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du MSCI Pacific ex Japan Index – Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice représente les grandes et moyennes capitalisations issues de 4 des 5 pays développés de la région Pacifique, à l'exception du Japon. Regroupant 147 sociétés au 30 janvier 2015, l'Indice couvre environ 85 % de la capitalisation boursière corrigée du flottant de chacun des pays suivants : Australie, Hong Kong, Nouvelle-Zélande et Singapour.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière corrigée du flottant qui mesure la performance des segments grandes et moyennes capitalisations sur les marchés d'Australie, de Hong Kong, de Nouvelle-Zélande et de Singapour.

L'Indice est basé sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices (GIMI), une approche complète et cohérente de la constitution de l'indice qui permet des perspectives mondiales et des comparaisons interrégionales significatives sur toutes les tailles de capitalisation boursière, tous les secteurs, tous les styles et toutes les combinaisons.

Cette méthodologie vise à fournir une couverture exhaustive de l'ensemble des opportunités d'investissement pertinentes en mettant fortement l'accent sur la liquidité, le caractère investissable et la reproductibilité de l'indice. Ces critères sont basés sur le rapport annuel de la valeur négociée (ATVR), ajouté à la Fréquence de négociation à 3 mois.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels (en février, mai, août et novembre).

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La méthodologie complète de l'Indice (y compris sa conservation et son rééquilibrage) peut être consultée sur le site Internet de MSCI : www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux grandes et moyennes capitalisations issues de 4 des 5 pays développés de la région Pacifique, à l'exception du Japon.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par

action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'Annexe C – Prise en compte des risques spécifiques et facteurs de risques, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI, par une quelconque autre filiale de MSCI ou par l'une quelconque des autres entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par le Gestionnaire. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI,

ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs d'Actions du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation d'actions de fonds en général ou d'actions de ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec le Gestionnaire ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins du Gestionnaire ou des porteurs d'Actions du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité d'Actions du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

MÊME EN CAS DE CONNAISSANCE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

BIEN QUE MSCI OBTIENNE DES DONNÉES INTÉGRÉES OU UTILISÉES DANS LE CALCUL DES INDICES PROVENANT DE SOURCES QUE MSCI ESTIME FIABLES, NI MSCI, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION OU LE CALCUL DES INDICES MSCI NE GARANTIT L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INTÉGRÉE. NI MSCI NI AUCUNE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION OU LE CALCUL DES INDICES MSCI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, CONCERNANT LES RÉSULTATS INDIQUANT QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE MSCI, LES CLIENTS DUDIT TITULAIRE DE LICENCE, LES CONTREPARTIES, LES PORTEURS DE PARTS DU FONDS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ OBTIENDRONT À LA SUITE DE L'UTILISATION DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INTÉGRÉE EN RELATION AVEC LES DROITS CONCÉDÉS OU À TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI NI AUCUNE AUTRE PARTIE NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI DÉCLINE TOUTE GARANTIE CONCERNANT LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UNE FIN SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DONNÉES INTÉGRÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS LA RESPONSABILITÉ DE MSCI OU DE TOUTE AUTRE PARTIE NE SERA ENGAGÉE POUR DE QUELCONQUES DOMMAGES QUE CEUX-CI SOIENT DIRECTS, INDIRECTS OU AUTRE (Y COMPRIS LA PERTE DE RÉSULTATS)

ANNEXE 12

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Fed Funds US Dollar Cash

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Fed Funds US Dollar Cash** est de refléter la performance de l'indice Solactive Fed Funds Effective Rate Total Return, libellé en dollars des États-Unis (l'« **Indice de référence** »).

Pour les catégories d'Actions Monthly Hedged mentionnées dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment aura également recours à une stratégie de couverture de change mensuelle, afin de réduire l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,02 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est représentatif de la performance d'un dépôt en espèces notionnel rémunéré selon le taux effectif des fonds fédéraux, c'est-à-dire le taux d'intérêt à court terme servant de référence sur le marché monétaire américain, avec un réinvestissement quotidien des intérêts dus sur le dépôt.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

Le taux des fonds fédéraux est le taux d'intérêt auquel les établissements de dépôt aux États-Unis peuvent se prêter mutuellement des liquidités au jour le jour. Le taux est calculé par le Federal Open Market Committee. Le taux d'intérêt effectif des fonds fédéraux correspond à la moyenne pondérée des taux relevés sur l'ensemble des transactions concernant ces fonds.

Il est calculé chaque jour ouvré aux États-Unis.

L'Indice de référence reflète la performance d'un dépôt en espèces rémunéré selon le taux effectif des fonds fédéraux, c'est-à-dire le taux d'intérêt à court terme servant de référence sur le marché monétaire américain, avec un réinvestissement quotidien des intérêts dus sur le dépôt.

La méthode de construction de l'Indice autorise la prise en compte des jours non ouvrés dans le calcul du taux d'intérêt selon une formule basée sur le dernier taux effectif disponible pour les fonds fédéraux.

Étant donné que l'Indice de référence est basé sur le taux d'intérêt effectif des fonds fédéraux, il ne sera pas soumis à une révision périodique.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur : www.solactive.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché monétaire américain.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,50 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque d'érosion du capital, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est pas garanti, promu, vendu ou soutenu par Solactive (le « **Concédant de la Licence** »). De même, le Concédant de la Licence ne donne à aucun moment une quelconque garantie ou assurance, expresse ou tacite, quant aux résultats obtenus en utilisant l'Indice de référence et/ou la marque de l'Indice ou son cours, ou à tout autre égard.

L'Indice de référence est calculé et publié par le Concédant de la Licence. Le Concédant de la Licence fait tout ce qui est en son pouvoir pour que l'Indice de référence soit calculé correctement. Indépendamment de ses obligations envers l'émetteur, le Concédant de la Licence n'est nullement tenu de signaler des erreurs présentes dans l'Indice de référence à

des tiers, y compris, notamment, les investisseurs et/ou les intermédiaires financiers du Compartiment. Le Concédant de la Licence ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice de référence ou de toute donnée liée à celui-ci et décline toute responsabilité quant à toute erreur, omission ou interruption affectant cet Indice.

Ni la publication de l'Indice de référence par le Concédant de la Licence, ni l'octroi d'une licence portant sur l'Indice de référence ou sa marque en vue de son utilisation aux fins du Compartiment n'a valeur de recommandation d'un investissement dans l'instrument financier susdit par le Concédant de la Licence, et ils n'impliquent en aucune manière une garantie ou un avis du Concédant de la Licence à l'égard de tout investissement dans ce Compartiment. Le Concédant de la Licence ne pourra en aucun cas être tenu pour responsable d'un manque à gagner ou d'un quelconque préjudice du fait de pertes ou de dommages et intérêts indirects, spéciaux ou pour préjudice moral, ou de dommages et intérêts indirects ou consécutifs, même s'il a été avisé de la possibilité de tels dommages ou pertes..

ANNEXE 13

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Pan Africa

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Pan Africa** consiste à répliquer, à la hausse comme à la baisse, l'indice SGI Pan Africa Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en euro (EUR), afin de procurer une exposition au marché actions des pays africains ou aux sociétés exerçant principalement leur activité sur le territoire africain, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice se compose des actions de sociétés cotées sur des places africaines ou exerçant principalement leur activité sur le territoire africain.

- **Méthodologie de l'Indice**

D'un point de vue géographique, l'Indice est composé :

- pour un tiers d'actions de sociétés sud-africaines,
- pour un deuxième tiers d'actions de sociétés cotées ou ayant leur activité principalement dans des pays d'Afrique du nord,
- et pour le dernier tiers d'actions de sociétés ayant leur activité principalement dans des pays d'Afrique sub-saharienne – hors Afrique du Sud.

Pour chacune de ces trois zones, les dix principales capitalisations boursières ont été sélectionnées pour entrer dans la composition de l'Indice, après prise en compte de leur liquidité. Aucune zone ne peut représenter moins de 25 % et plus de 50 % de la capitalisation totale de l'Indice.

Aucune action ne peut représenter plus de 10 % de l'Indice.

La répartition initiale des places de cotation des actions de l'Indice est : Johannesburg (Afrique du Sud), Le Caire (Égypte), Casablanca (Maroc), Londres (Royaume-Uni), Toronto (Canada) et New York (États-Unis).

La composition de l'Indice est révisée et repondérée tous les trimestres.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'Indice.

L'Indice est calculé par Standard & Poor's.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet suivant : <http://www.sgindex.com>.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <https://www.sgindex.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres

OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché des sociétés cotées sur des places africaines ou exerçant principalement leur activité sur le territoire africain.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

Compte tenu de la fermeture de la Bourse du Caire (Égypte) le vendredi, les souscriptions seront réalisées sur la base de la valeur liquidative du Jour de valorisation défini ci-dessous :

Souscription un lundi, un mardi ou un mercredi	Valeur liquidative du jour suivant de la même semaine
Souscription un jeudi ou un vendredi	Valeur liquidative du lundi de la semaine suivante

Les rachats seront réalisés sur la base de la valeur liquidative du Jour de valorisation défini ci-dessous :

Rachat un lundi, un mardi ou un mercredi	Valeur liquidative du jour suivant de la même semaine
Rachat un jeudi ou un vendredi	Valeur liquidative du lundi de la semaine suivante

« Heure limite de passation des ordres » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque lié à une faible diversification, Risque lié à l'investissement dans les pays émergents et en voie de développement, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif

d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est en aucune façon parrainé, soutenu, promu ou commercialisé par Société Générale Index (SGI), qui est une marque déposée du Groupe Société Générale (ci-après le « Concédant de la Licence »).

Le Concédant de licence n'assume aucune obligation et ne fournit aucune garantie, qu'elle soit expresse ou tacite, concernant les résultats pouvant être obtenus en utilisant l'Indice et/ou la valeur de cet indice à n'importe quelle heure de n'importe quel jour, ou toute autre obligation ou garantie. Le Concédant de licence ne saurait être tenu pour responsable vis-à-vis de quiconque (que ce soit la conséquence d'une négligence ou pour toute autre raison) quant à toute erreur affectant l'Indice et ne saurait être tenu d'informer quiconque d'une telle erreur.

L'Indice est la propriété exclusive de Société Générale. Société Générale a signé un contrat avec Standard & Poor's (S&P) selon lequel S&P s'engage à calculer l'Indice et à le tenir à jour. Toutefois, S&P décline toute responsabilité quant à toute erreur ou omission relative au calcul de l'Indice.

ANNEXE 14

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 5-7Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 5-7Y** consiste à refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 5-7 Year Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« Écart de suivi »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C - RÉCAPITULATIF DES ACTIONS ET DES FRAIS, le Compartiment mettra également en œuvre une stratégie de couverture mensuelle du risque de change visant à réduire l'incidence d'une fluctuation de la devise de la catégorie d'actions par rapport à la devise dans laquelle les composantes de l'indice sont libellées.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 5-7 Year Bond procure une exposition aux emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis par les pays membres de l'Union Monétaire Européenne. Il contient des obligations libellées en euro dont l'échéance est d'au moins cinq ans, mais inférieure à sept ans.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire qui est calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 5-7 Year Bond mesure la performance des obligations d'État investment grade de la zone euro. Il contient exclusivement des obligations libellées en euro assorties d'une échéance d'au moins cinq ans, mais inférieure à sept ans.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que

les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction, ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent être exposés aux obligations émises par des États membres de la zone euro.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,5 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risque lié au prêt de titres, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important

sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 15

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 7-10Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 7-10Y** consiste à refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 7-10 Year Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« Écart de suivi »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C - RÉCAPITULATIF DES ACTIONS ET DES FRAIS, le Compartiment mettra également en œuvre une stratégie de couverture mensuelle du risque de change visant à réduire l'incidence d'une fluctuation de la devise de la catégorie d'actions par rapport à la devise dans laquelle les composantes de l'indice sont libellées.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

Le Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 7-10 Year Bond Index offre une exposition à des obligations publiques à taux fixe de qualité « investment grade » émises par des pays souverains participant à l'Union monétaire européenne. Cet indice contient des obligations libellées en euros dont l'échéance est comprise entre sept et dix ans (non inclus).

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire, calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

Le Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 7-10 Year Bond Index mesure la performance du marché des obligations d'État de la zone euro de qualité « investment grade ». Seules les obligations libellées en euros et dont l'échéance est comprise entre sept et dix ans (non inclus) sont incluses.

L'Indice de référence est un indice de rendement total. Un indice de rendement total calcule la

performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction, ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent être exposés aux obligations émises par des États membres de la zone euro.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées

tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,5 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risque lié au prêt de titres, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 16

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 15+Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 15+Y** consiste à refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 15+ Year Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« Écart de suivi »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C - RÉCAPITULATIF DES ACTIONS ET DES FRAIS, le Compartiment mettra également en œuvre une stratégie de couverture mensuelle du risque de change visant à réduire l'incidence d'une fluctuation de la devise de la catégorie d'actions par rapport à la devise dans laquelle les composantes de l'indice sont libellées.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,30 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 15+ Year Bond procure une exposition aux emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis par les pays membres de l'Union Monétaire Européenne. Il contient des obligations libellées en euro dont l'échéance est supérieure à quinze ans.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire qui est calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 15+ Year Bond mesure la performance des obligations d'État investment grade de la zone euro. Il contient exclusivement des obligations libellées en euro assorties d'une échéance supérieure à quinze ans.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que

les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction, ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse : <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent être exposés aux obligations émises par des États membres de la zone euro.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus),

les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,5 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risque lié au prêt de titres, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci .

ANNEXE 17

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond** est de refléter la performance de l'indice FTSE MTS Highest Rated Macro-Weighted Government Bond (Mid Price) (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,30 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est représentatif de la performance des titres obligataires émis par les États membres de la zone euro qui satisfont aux critères d'éligibilité des indices FTSE MTS.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence se compose de titres obligataires émis par les États membres de la zone euro ayant les meilleures notations de crédit (au moins deux notations égales à « AAA » ou équivalent chez les trois agences de notations S&P, Moody's et Fitch). Leur pondération dans l'Indice est calculée sur la base d'indicateurs macroéconomiques.

L'Indice de référence doit comprendre au minimum cinq pays émetteurs. Dans l'éventualité d'une dégradation de la notation d'un émetteur, celui-ci sera remplacé par un autre pays émetteur admissible afin de conserver le nombre minimum de cinq émetteurs requis dans l'Indice.

Ainsi les titres composant l'Indice ont une qualité de crédit parmi les plus hautes des États souverains de la zone euro.

L'univers d'investissement éligible de l'Indice de référence se compose de titres obligataires qui satisfont aux critères suivants :

- nominal et coupons libellés en euros, n'incluant pas d'option, ni de convertibilité ;
- négociés sur la plateforme FTSE MTS ;

- émis par un gouvernement souverain d'un État membre de la zone euro ayant au moins deux notations AAA chez les trois agences de notations S&P, Moody's et Fitch, et sélectionné par FTSE MTS ;
- montant minimal d'encours de 2 milliards EUR ;
- maturité supérieure ou égale à 1 an.

La composition de l'Indice de référence est révisée et repondérée tous les mois.

L'Indice de référence est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'Indice.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <http://www.ftse.com/>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <http://www.ftse.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de procéder ponctuellement à des opérations de prêt de titres dans un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) réduction du risque ;

(ii) réduction du coût ; ou (iii) génération de capital ou de revenus supplémentaires pour l'OPCVM avec un niveau de risque compatible avec le profil de risque de l'OPCVM et les règles de diversification des risques énoncées à l'article 52 de la directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 qui porte sur la coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent être exposés aux obligations émises par des États membres de la zone euro.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 3 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risque lié au prêt de titres, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le

Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par FTSE TMX Global Debt Capital Markets (les « **Détenteurs** »).

Les Détenteurs ne peuvent être tenus pour responsable de la promotion ou de la commercialisation du Compartiment.

FTSE MTS, les noms d'indice FTSE MTS (FTSE MTS IndexTM) et les indices FTSE MTS (FTSE MTS IndicesTM) sont des marques déposées des Détenteurs. Les indices FTSE MTS sont calculés par les Détenteurs, et sont commercialisés et distribués par MTSNext, une société filiale des Détenteurs.

Ni les Détenteurs, ni MTSNext ne sauraient être tenus pour responsables de toute perte ou dommage, de quelque nature que ce soit (y compris, notamment, les pertes d'investissement) liés en tout ou en partie au Compartiment ou à la fourniture de l'Indice de référence, d'un sous-indice ou d'une marque déposée.

ANNEXE 18

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 Daily (-2x) Inverse

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P 500 Daily (-2x) Inverse UCITS ETF** (le « **Compartiment** ») consiste à répliquer, à la hausse comme à la baisse, l'indice S&P 500[®] 2X Inverse Daily (l'« **Indice** »), libellé en dollars des États-Unis, afin de procurer une exposition inverse au marché actions des États-Unis avec un effet de levier quotidien de 2, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice procure une performance égale au double de la performance inverse de l'indice S&P 500[®] (l'« **Indice Parent** ») et représente une position vendeuse sur ce dernier. Le S&P 500 est un indice pondéré par le flottant publié depuis 1957 qui décrit le cours des actions ordinaires de 500 valeurs à forte capitalisation ; il vise à refléter la performance des marchés boursiers des États-Unis et, à travers ces derniers, celle de l'économie américaine. Les actions incluses dans le S&P 500 sont celles de sociétés américaines cotées sur l'un des segments admissibles du NYSE et du NASDAQ.

L'indice fait l'objet d'un ajustement afin de tenir compte des intérêts acquis sur l'investissement initial ainsi que sur les produits générés par la vente à découvert des titres compris dans l'Indice Parent.

La méthode de construction de l'Indice est décrite de manière exhaustive à l'adresse www.standardandpoors.com.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice Parent comprend les titres de 500 grandes sociétés américaines. Les valeurs sont sélectionnées sur des critères de domiciliation, de capitalisation boursière, de flottant, de solidité financière et de liquidité. La composition de

l'Indice est révisée en parallèle avec celle de l'Indice Parent.

Le Comité de l'Indice S&P actualise sa composition en suivant un ensemble de règles publiques. Des explications exhaustives sur ces règles, y compris les critères d'inclusion dans l'indice et de retrait de celui-ci, les déclarations de politique et les documents de recherche sont disponibles sur le site Internet : www.indices.standardandpoors.com.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels ou, dans certains cas précis décrits de façon plus détaillée dans les règles publiques susmentionnées, à une date anticipée fixée par le promoteur de l'Indice.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

La performance calculée sur un jour de bourse de l'Indice est égale au double de la performance inversée de l'Indice Parent sur ce même jour de bourse, dividendes et variations de cours compris, cumulée des intérêts (au taux LIBOR à un jour) perçus quotidiennement sur trois fois la valorisation du cours de clôture de l'Indice Parent. L'Indice ne prend pas en compte le coût de la vente à découvert des titres sous-jacents à l'Indice Parent. Le facteur de levier utilisé dans la formule de calcul de l'Indice est réajusté quotidiennement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet www.standardandpoors.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA), ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition inverse avec un effet de levier de 2 au marché actions des États-Unis.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de levier, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

En outre, le Compartiment est exposé au risque suivant :

- Risque lié au réajustement quotidien du levier

Les investisseurs sont inversement et doublement exposés aux fluctuations quotidiennes qui affectent le prix ou le niveau de l'Indice Parent. En particulier, toute hausse sur le marché sous-jacent sera amplifiée et entraînera une dépréciation encore plus forte de la valeur liquidative du Compartiment. Le réajustement quotidien prévu par la formule de l'indice de

stratégie « double short » sous-jacent implique que, sur des périodes supérieures à un jour ouvré, la performance de l'Indice ne sera pas égale au double de la performance inverse de l'exposition à l'Indice Parent. Cet effet sera d'autant plus fort que la volatilité de l'Indice Parent augmente.

Par exemple, si l'Indice Parent se déprécie de 5 % par jour pendant deux jours ouvrés consécutifs, cela se traduira par une appréciation totale de l'Indice de 21 % (avant déduction des commissions applicables) tandis que l'Indice Parent se sera déprécié de 9,75 % sur la même période : le levier est supérieur à deux. Dans d'autres cas de figure, le levier pourrait être inférieur à 2.

Si l'Indice Parent s'apprécie de 10 % le premier jour puis se déprécie de 5 % le jour suivant, l'Indice affichera alors un recul global de 12 % après ces deux jours (avant déduction des commissions applicables) tandis que l'Indice Parent se sera apprécié de 4,5 % sur la même période : par rapport à l'exemple précédent, la volatilité plus forte entraîne un levier également plus important.

Il se peut également que la valeur de l'Indice diminue alors même que l'Indice Parent enregistre une baisse sur cette période. Si l'Indice Parent se déprécie de 10 % le premier jour puis s'apprécie de 10 % le jour suivant, l'Indice affichera alors un recul global de 4 % après ces deux jours (avant déduction des commissions applicables) tandis que l'Indice Parent se sera déprécié de 1 % sur la même période.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par Standard & Poor's et ses sociétés affiliées (« S&P »). S&P s'abstient de toute déclaration ou condition et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires du fonds ou à un quelconque membre du public quant à l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le fonds en particulier ou quant à la capacité de l'Indice de reproduire la performance de certains marchés financiers et/ou compartiments de ceux-ci et/ou groupes ou classes d'actifs. Le seul lien entre S&P et Amundi Asset Management consiste en l'octroi de licences sur certaines marques et appellations commerciales ainsi que sur l'Indice qui est compilé, composé et calculé par S&P sans égard pour Amundi Asset Management et pour le fonds. S&P n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins d'Amundi Asset Management ou des propriétaires du fonds lorsqu'il compile, compose ou calcule l'Indice. S&P ne peut être tenu pour responsable de et n'a pas participé à la détermination des prix et des volumes du compartiment, non plus qu'à la fixation de la date de l'émission ou de la vente du compartiment ou à la détermination ou au calcul de l'équation régissant la conversion des parts du compartiment en espèces. S&P n'a aucune obligation ou responsabilité quant à l'administration, la commercialisation ou la négociation du compartiment.

S&P ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice, non plus que d'une quelconque donnée qu'il intègre, et S&P décline toute responsabilité quant à toute erreur, omission ou interruption affectant cet Indice. S&P s'abstient de toute déclaration ou condition et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires du fonds ou à une quelconque autre personne physique ou morale, quant aux résultats qu'Amundi Asset Management retirera de l'utilisation de l'Indice ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. S&P s'abstient de toute déclaration ou condition et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, il décline expressément toute garantie ou condition quant à la qualité marchande ou l'adéquation à un usage donné ou une finalité particulière de l'Indice ou d'une quelconque donnée incorporée dans celui-ci et il décline expressément toute autre garantie, expresse ou tacite, quant à cet Indice. Sans préjudice de ce qui précède, S&P ne pourra en aucun cas être tenu pour responsable d'un quelconque préjudice du fait de dommages et intérêts spéciaux, indirects ou pour préjudice moral, ou de dommages et intérêts indirects (y compris pour un manque à gagner) résultant de l'utilisation de l'Indice ou d'une quelconque donnée incorporée dans celui-ci, même s'il a été averti de la possibilité de tels dommages.

ANNEXE 19

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y** est de refléter la performance de l'indice Markit iBoxx EUR Breakeven Euro-Inflation France & Germany (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, afin de procurer une exposition à une position acheteuse sur des obligations indexées sur l'inflation émises par la France et l'Allemagne, et à une position vendeuse sur des obligations souveraines françaises et allemandes présentant des durations équivalentes.

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est représentatif de la performance d'une position acheteuse sur des obligations indexées sur l'inflation (les « **OII** ») émises par la France et l'Allemagne et d'une position vendeuse sur des obligations souveraines de ces deux pays présentant des durations équivalentes.

L'écart de rendement (ou « **spread** ») entre ces obligations est communément désigné sous le terme « **point mort d'inflation** » (PMI) et considéré comme une mesure des anticipations d'inflation du marché sur une période déterminée.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est conçu de façon à permettre une exposition aux changements dans les anticipations d'inflation intégrées par le marché en prenant une position acheteuse sur des OII émises par la France et l'Allemagne et une position vendeuse sur des obligations

souveraines de ces deux pays présentant des durations équivalentes.

La combinaison de positions acheteuses et vendeuses supprime les effets indésirables liés à la durée des titres à taux fixe, ce qui permet une exposition, principalement, mais de façon non limitative : aux changements dans les anticipations d'inflation.

Les obligations auront les caractéristiques suivantes :

Obligations émises en priorité par la France et l'Allemagne avec un encours minimum de 5 milliards d'euros.

L'indice d'inflation de base des OII est l'indice des prix à la consommation harmonisé.

Les échéances des obligations sont comprises entre 2 et 10 ans.

À chaque date de rééquilibrage, l'exposition à l'une quelconque des obligations indexées sur l'inflation considérées et à l'une quelconque des obligations issues de la fraction des obligations souveraines nominales ne peut dépasser 30 %. De plus, l'Indice de référence doit à tout moment contenir au moins six OII et six obligations souveraines nominales.

En raison des caractéristiques obligataires décrites ci-dessus, il se peut que ces contraintes de diversification ne soient pas respectées. Si tel est le cas, certaines de ces caractéristiques peuvent être assouplies selon les modalités détaillées décrites dans la méthode de construction de l'Indice de référence et consultables en ligne sur le site Internet : www.markit.com/product/indices.

La performance journalière de l'Indice de référence ne sera pas mesurée par la variation quotidienne du point mort d'inflation (« **PMI** ») ni par un coefficient multiplicateur de cette variation, mais par la surperformance quotidienne du panier de positions acheteuses liées à l'inflation par rapport au panier de positions vendeuses sur obligations nominales, laquelle est théoriquement corrélée à l'évolution de l'inflation attendue par le marché à l'échéance des obligations, représentée par le PMI à l'échéance considérée.

En théorie, une augmentation de l'anticipation d'inflation à n ans entraîne une diminution relative du prix de l'obligation nominale à n ans par rapport au prix de l'OII équivalente et, par conséquent, une augmentation de la performance d'une position acheteuse sur l'OII et d'une position vendeuse sur l'obligation nominale. L'Indice de référence étant composé d'une position acheteuse sur plusieurs OII et d'une position vendeuse sur plusieurs obligations nominales à échéances variées, sa performance sera liée à la moyenne pondérée des anticipations d'inflation correspondant aux dates

d'échéance des obligations comprises dans le panier. En outre, (i) les mouvements de prix découlant des divergences d'offre et de demande entre les OII et les obligations nominales correspondantes, (ii) les frais de transaction applicables aux composantes de l'Indice de référence et (iii) les cycles saisonniers et les positions susceptibles de générer un portage négatif du fait de la saisonnalité (cf. le facteur de risque spécifique ci-après) donneront lieu à des écarts entre la performance de l'Indice de référence et les anticipations d'inflation.

Il convient également de noter que l'Indice de référence ne permet pas de mesurer le taux d'inflation réalisé et n'a pas non plus pour objectif de reproduire la performance d'un indice quelconque ni de mesurer le niveau réel des prix à la consommation. Toutefois, l'inflation réalisée affectera ponctuellement la performance de l'Indice de référence, en règle générale lorsqu'elle diffère de l'anticipation du marché sur une période donnée.

La composition de l'Indice de référence est révisée et pondérée tous les mois.

L'Indice de référence est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'indice selon le critère que tout coupon ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet suivant :

www.markit.com/product/indices

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse www.markit.com/product/indices.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la

partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux changements dans les anticipations d'inflation en France et en Allemagne.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs

marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de perspective d'inflation, Risque spécifique en raison de la saisonnalité et de la poursuite de l'inflation, Risque associé au coût élevé d'investissement dans une stratégie long/short et/ou à effet de levier, Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se

trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

L'Indice de référence en question est la propriété de Markit Indices Limited (le « Promoteur de l'Indice ») et a été concédé sous licence au Compartiment.

Les parties conviennent que le Compartiment n'est ni agréé ni recommandé par le Promoteur de l'Indice.

En aucun cas le Commanditaire de l'Indice ne fournit de garantie – explicite ou implicite (y compris, mais sans s'y limiter, la valeur commerciale ou le caractère approprié pour toute fin spécifique) – quant à l'Indice de référence ou à toute donnée incluse dans ou liée à l'Indice de référence et, en particulier, décline toute garantie quant à la qualité, l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice de référence ou des données incluses dans ou liées à l'Indice de référence, ou aux résultats obtenus à la suite de l'utilisation de l'Indice de référence et/ou de la composition de l'Indice de référence à une date ou un moment donnés, de même que la notation financière de toute entité émettrice ou tout événement de crédit ou similaire (quelle que soit la définition de cet événement) liée à une obligation dans l'Indice de référence à une date donnée ou à tout autre moment.

Le Promoteur de l'Indice ne peut être tenu responsable pour quelque raison que ce soit d'une erreur dans l'Indice de référence et n'est pas tenu d'informer d'une telle erreur, dans le cas où elle surviendrait.

En aucun cas le Promoteur de l'Indice n'émet une recommandation d'achat ou de vente dans le Compartiment ni n'exprime d'opinion quant à la capacité de l'Indice de référence à reproduire la performance des marchés concernés, ou concernant l'Indice ou toute opération ou produit y relatifs, ou sur les risques y afférents.

Le Promoteur de l'Indice n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins d'un tiers lorsqu'il compile, modifie, compose ou calcule

l'Indice de référence. La responsabilité de l'acheteur ou d'un vendeur du Compartiment et du Promoteur de l'Indice ne peut pas être engagée dans le cas où le Promoteur de l'Indice ne prendrait pas les mesures nécessaires pour compiler, ajuster ou calculer l'Indice de référence.

Le Promoteur de l'Indice et ses sociétés affiliées se réservent le droit de traiter toute obligation qui compose l'Indice de référence et peuvent, le cas échéant, accepter des dépôts, accorder des prêts ou effectuer toute autre activité de crédit, et plus généralement, exercer l'un ou la totalité des services financiers et de banque d'investissement ou toute autre activité commerciale auprès de ces émetteurs obligataires ou de leurs sociétés affiliées ; en outre, ils peuvent entreprendre ces activités comme si l'Indice de référence n'existait pas, sans tenir compte de leurs éventuelles conséquences sur celui-ci ou le Compartiment.

ANNEXE 20

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Inflation Expectations 10Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Inflation Expectations 10Y** est de refléter la performance de l'indice Markit iBoxx USD Breakeven 10-Year Inflation (l'« **Indice de référence** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), afin de procurer une exposition à une position acheteuse sur des titres à 10 ans du Trésor américain protégés contre l'inflation (TIPS) et à une position vendeuse sur des bons du Trésor américain présentant des durations équivalentes.

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est représentatif de la performance d'une position acheteuse sur les 6 dernières émissions de titres à 10 ans du Trésor américain protégés contre l'inflation (les « **TIPS** ») et d'une position vendeuse sur des bons du Trésor américain présentant des durations équivalentes, aucune émission ne représentant plus de 30 % de la position à chaque date de rééquilibrage.

L'écart de rendement (ou « spread ») entre ces obligations est communément désigné sous le terme « point mort d'inflation » (PMI) et considéré comme une mesure des anticipations d'inflation du marché sur une période déterminée.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est conçu de façon à permettre une exposition aux changements dans les anticipations d'inflation intégrées par le marché en prenant :

- une position acheteuse sur les six dernières émissions de TIPS américains à 10 ans ;
- une position vendeuse sur des bons du Trésor américain présentant des durations équivalentes.

Les TIPS américains à 10 ans sont indexés sur l'indice des prix à la consommation aux États-Unis.

La combinaison de positions longues et courtes supprime les effets indésirables liés à la durée des titres à taux fixe, ce qui permet une exposition, principalement, mais de façon non limitative : aux changements dans les anticipations d'inflation à 10 ans.

La performance journalière de l'Indice de référence ne sera pas mesurée par la variation quotidienne du point mort d'inflation (« **PMI** ») ni par un coefficient multiplicateur de cette variation, mais par la surperformance quotidienne du panier de positions acheteuses liées à l'inflation par rapport au panier de positions vendeuses sur obligations nominales, laquelle est théoriquement corrélée à l'évolution de l'inflation attendue par le marché à l'échéance des obligations, représentée par le PMI à l'échéance considérée.

En théorie, une augmentation de l'anticipation d'inflation à n ans entraîne une diminution relative du prix de l'obligation nominale à n ans par rapport au prix de l'OII équivalente et, par conséquent, une augmentation de la performance d'une position acheteuse sur l'OII et d'une position vendeuse sur l'obligation nominale. L'Indice de référence étant composé d'une position acheteuse sur plusieurs OII et d'une position vendeuse sur plusieurs obligations nominales à échéances variées, sa performance ne sera pas liée exclusivement à l'anticipation d'inflation à 10 ans, mais à la moyenne pondérée des anticipations d'inflation correspondant aux dates d'échéance des obligations comprises dans le panier. En outre, (i) les mouvements de prix découlant des divergences d'offre et de demande entre les OII et les obligations nominales correspondantes, (ii) les frais de transaction applicables aux composantes de l'Indice de référence et (iii) les cycles saisonniers et les positions susceptibles de générer un portage négatif du fait de la saisonnalité (cf. le facteur de risque spécifique ci-après) donneront lieu à des écarts entre la performance de l'Indice de référence et les anticipations d'inflation.

Il convient également de noter que l'Indice de référence ne permet pas de mesurer le taux d'inflation réalisé et n'a pas non plus pour objectif de reproduire la performance d'un indice quelconque ni de mesurer le niveau réel des prix à la consommation. Toutefois, l'inflation réalisée affectera ponctuellement la performance de l'Indice de référence, en règle générale

lorsqu'elle diffère de l'anticipation du marché sur une période donnée.

La composition de l'Indice de référence est révisée et repondérée tous les mois.

L'Indice de référence est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'indice selon le critère que tout coupon ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet suivant :

www.markit.com/product/indices

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse www.markit.com/product/indices.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE

FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux changements dans les anticipations d'inflation aux États-Unis.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à

la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de perspective d'inflation, Risque spécifique en raison de la saisonnalité et de la poursuite de l'inflation, Risque associé au coût élevé d'investissement dans une stratégie long/short et/ou à effet de levier, Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

L'Indice de référence en question est la propriété de Markit Indices Limited (le « Promoteur de

l'Indice ») et a été concédé sous licence au Compartiment.

Les parties conviennent que le Compartiment n'est ni agréé ni recommandé par le Promoteur de l'Indice.

En aucun cas le Commanditaire de l'Indice ne fournit de garantie – explicite ou implicite (y compris, mais sans s'y limiter, la valeur commerciale ou le caractère approprié pour toute fin spécifique) – quant à l'Indice de référence ou à toute donnée incluse dans ou liée à l'Indice de référence et, en particulier, décline toute garantie quant à la qualité, l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice de référence ou des données incluses dans ou liées à l'Indice de référence, ou aux résultats obtenus à la suite de l'utilisation de l'Indice de référence et/ou de la composition de l'Indice de référence à une date ou un moment donnés, de même que la notation financière de toute entité émettrice ou tout événement de crédit ou similaire (quelle que soit la définition de cet événement) liée à une obligation dans l'Indice à une date donnée ou à tout autre moment.

Le Promoteur de l'Indice ne peut être tenu responsable pour quelque raison que ce soit d'une erreur dans l'Indice de référence et n'est pas tenu d'informer d'une telle erreur, dans le cas où elle surviendrait.

En aucun cas le Promoteur de l'Indice n'émet une recommandation d'achat ou de vente dans le Compartiment ni n'exprime d'opinion quant à la capacité de l'Indice de référence à reproduire la performance des marchés concernés, ou concernant l'Indice de référence ou toute opération ou produit y relatifs, ou sur les risques y afférents.

Le Promoteur de l'Indice n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins d'un tiers lorsqu'il compile, modifie, compose ou calcule l'Indice de référence. La responsabilité de l'acheteur ou d'un vendeur du Compartiment et du Promoteur de l'Indice ne peut pas être engagée dans le cas où le Promoteur de l'Indice ne prendrait pas les mesures nécessaires pour compiler, ajuster ou calculer l'Indice de référence.

Le Promoteur de l'Indice et ses sociétés affiliées se réservent le droit de traiter toute obligation qui compose l'Indice et peuvent, le cas échéant, accepter des dépôts, accorder des prêts ou effectuer toute autre activité de crédit, et plus généralement, exercer l'un ou la totalité des services financiers et de banque d'investissement ou toute autre activité commerciale auprès de ces émetteurs obligataires ou de leurs sociétés affiliées ; en outre, ils peuvent entreprendre ces activités comme si l'Indice n'existait pas, sans tenir compte de leurs éventuelles conséquences sur l'Indice de référence ou le Compartiment.

ANNEXE 21

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 1-3Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 1-3Y** est de refléter la performance du Bloomberg Barclays US Treasury 1-3 Year Index (ci-après l'« Indice de référence ») libellée en USD et représentative des « Obligations du Trésor » des États-Unis, avec une échéance résiduelle allant de 1 à 3 ans (exclus), tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Erreur de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence procure une exposition aux bons du Trésor américain ayant une échéance résiduelle d'au moins un an, mais inférieure à trois ans.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire, calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'Indice de référence mesure la performance du marché des emprunts d'État américains. Il contient exclusivement des obligations libellées en dollar émises par le gouvernement américain, dont l'échéance résiduelle est d'au moins un an, mais inférieure à trois ans.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de

rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur : <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres

OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent adopter une exposition « cœur de portefeuille » à long terme (approche « buy-and-hold ») à la performance des principaux segments du marché des obligations à long terme libellées en USD et en particulier à celle des bons du Trésor américain.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment émet des Actions UCITS ETF. Les Actions UCITS ETF seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions UCITS ETF ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le

Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 22

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 3-7Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 3-7Y** est de refléter la performance du Bloomberg Barclays US Treasury 3-7 Year Index (ci-après l'« **Indice de référence** ») libellée en USD et représentative des « Obligations du Trésor » des États-Unis, avec une échéance résiduelle allant de 3 à 7 ans (exclus), tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Erreur de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence procure une exposition aux bons du Trésor américain ayant une échéance résiduelle d'au moins trois ans, mais inférieure à sept ans.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire, calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'Indice de référence mesure la performance du marché des emprunts d'État américains. Il contient exclusivement des **obligations** libellées en dollar émises par le gouvernement américain, dont l'échéance résiduelle est d'au moins trois ans, mais inférieure à sept ans.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de

rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur : <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres

OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent adopter une exposition « cœur de portefeuille » à long terme (approche « buy-and-hold ») à la performance des principaux segments du marché des obligations à moyen terme libellées en USD et en particulier à celle des bons du Trésor américain.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment émet des Actions UCITS ETF. Les Actions UCITS ETF seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions UCITS ETF ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit (*Compartiments qui utilisent des stratégies neutres en crédit [comme celles conçues pour fournir un rendement lié aux prévisions d'inflation]*), Capital à risque, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux

Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (conjointement « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent en aucun cas l'actualité, l'exactitude ou l'exhaustivité des données ou informations relatives à l'Indice, et ne sauraient être tenus responsables envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou d'autres tiers de l'utilisation ou de l'exactitude de l'Indice de référence ou de toute donnée y figurant.

ANNEXE 23

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond Long Dated.

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond Long Dated** est de refléter la performance du Bloomberg Barclays US Long Treasury Index (ci-après l'« **Indice de référence** ») libellée en USD et représentative des « Obligations du Trésor » des États-Unis, avec une échéance résiduelle allant supérieure à 10 ans, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,30 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence procure une exposition aux bons du Trésor américain ayant une échéance résiduelle supérieure à dix ans.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire, calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'Indice de référence mesure la performance du marché des emprunts d'État américains. Il contient exclusivement des obligations libellées en dollar émises par le gouvernement américain, dont l'échéance résiduelle est supérieure à 10 ans.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total calcule la performance des

composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur : <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent adopter une exposition « cœur de portefeuille » à long terme (approche « buy-and-hold ») à la performance des principaux segments du marché des obligations à long terme libellées en USD et en particulier à celle des bons du Trésor américain.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment émet des Actions UCITS ETF. Les Actions UCITS ETF seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés

réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions UCITS ETF ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section du présent Prospectus intitulée Politique de distribution.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 24

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor iBoxx £ Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le GBP.

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor iBoxx £ Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF** est de permettre une exposition à la hausse comme à la baisse des principaux segments du marché des obligations d'entreprises libellées en GBP, en répliquant l'évolution de l'indice Markit iBoxx GBP Liquid Corporates Long Dated Mid Price TCA (l'« **Indice de référence** »), tout en minimisant l'écart de suivi entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

• Objectifs de l'Indice de référence

L'Indice de référence est issu de la famille d'indices Markit iBoxx GBP Liquid, laquelle est représentative des principaux segments du marché des obligations libellées en GBP répondant à des critères spécifiques de liquidité. Les indices Markit iBoxx GBP Liquid indices constituent le sous-ensemble le plus aisément répliquable de la famille d'indices Markit iBoxx GBP. L'Indice de référence représente en particulier le marché des obligations non gouvernementales liquides libellées en GBP.

• Méthodologie de l'Indice de référence

Pour pouvoir être incluse dans l'Indice de référence, une obligation doit satisfaire à des critères spécifiques qui ont trait à son échéance résiduelle (1,5 an à la date de rééquilibrage) et au volume d'émission (au moins 250 millions GBP). Le nombre d'émetteurs de l'Indice de référence doit être compris entre 25 et 40. Chaque obligation est pondérée en fonction de

son encours notionnel, son poids relatif étant déterminé par le rapport entre sa capitalisation et celle de l'indice. Ce poids est plafonné à 4 %.

L'Indice est repondéré trimestriellement, le dernier jour des mois de février, mai, août et novembre.

L'Indice de référence du Compartiment, libellé en GBP, est un indice de « rendement total » (les coupons détachés des composantes de l'indice sont réinvestis dans celui-ci) qui est « ajusté des coûts de transaction » (les coûts d'achat et de vente des titres à chaque date de rééquilibrage sont intégrés dans le rendement de l'indice).

L'Indice de référence s'appuie notamment sur les données de référence et le service d'évaluation des obligations fourni par Markit (Markit Reference Data - Evaluated Bond Pricing Service). Les prix collectés par Markit proviennent notamment d'extraits de registres, de l'analyse des indications de prix à l'achat ou à la vente transmises par les courtiers à leurs clients, des déclarations relatives aux prix des transactions et des ordres exécutés.

L'Indice de référence est construit, administré et géré par Markit.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composants sont disponibles sur le site Internet à l'adresse : www.markit.com.

• Informations complémentaires sur l'Indice de référence

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse www.markit.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent s'exposer aux principaux segments du marché des obligations d'entreprises libellées en GBP.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte

pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 3 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union

européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

conséquences sur l'Indice de référence ou le Compartiment.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

L'Indice de référence est une marque de Markit Indices Co (« Markit », également désigné le « Promoteur de l'Indice ») concédé sous licence à Amundi Asset Management.

L'Indice de référence en question est la propriété de Markit Indices Limited et il est utilisé sous licence par le Compartiment.

Le Compartiment n'est ni agréé ni recommandé par le Promoteur de l'Indice.

En aucun cas le Promoteur de l'Indice ne fournit une quelconque garantie, expresse ou tacite, se rapportant aux données de l'Indice de référence ou à la qualité, l'exactitude ou l'exhaustivité de ces données, ou à la notation de crédit de toute entité émettrice. Il décline en outre toute responsabilité quant à l'utilisation de l'Indice de référence et/ou sa composition. Le Promoteur de l'Indice ne pourra être tenu responsable pour quelque raison que ce soit d'une erreur dans l'Indice de référence et n'est pas tenu d'informer quiconque d'une telle erreur, dans le cas où elle surviendrait.

En aucun cas le Promoteur de l'Indice n'émet une recommandation d'achat ou de vente dans le Compartiment ni n'exprime d'opinion quant à la capacité de l'Indice de référence à reproduire la performance des marchés concernés, ou concernant l'Indice de référence ou toute opération ou produit y relatifs, ou sur les risques y afférents. Le Promoteur de l'Indice n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins d'un tiers lorsqu'il compile ou calcule l'Indice de référence ou lorsqu'il en modifie la composition. La responsabilité d'un acheteur ou d'un vendeur du Compartiment ou du Promoteur de l'Indice ne pourra pas être engagée dans le cas où le Promoteur de l'Indice ne prendrait pas les mesures nécessaires pour compiler, ajuster ou calculer l'Indice de référence. Le Promoteur de l'Indice et ses sociétés affiliées se réservent le droit de négocier toute obligation qui compose l'Indice de référence et peuvent, le cas échéant, accepter des dépôts, accorder des prêts ou effectuer toute autre activité de crédit, et plus généralement, exercer tous les services financiers et de banque d'investissement ou toute autre activité commerciale auprès de ces émetteurs obligataires ou de leurs sociétés affiliées ; en outre, ils peuvent entreprendre ces activités comme si l'Indice de référence n'existait pas, sans tenir compte de leurs éventuelles

ANNEXE 25

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi UK Government Bond

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le GBP.

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi UK Government Bond** est de refléter la performance de l'indice FTSE Actuaries UK Conventional Gilts All Stocks (l'« **Indice de référence** ») libellé en livres sterling (GBP), représentatif des emprunts d'État britanniques (« Gilts ») libellés en GBP, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence fait partie de la famille d'indices FTSE Actuaries UK Gilt, laquelle représente le marché des emprunts d'État britanniques. L'Indice de référence comprend des Gilts classiques couvrant toutes les catégories d'échéances.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

Hormis certaines catégories, (par exemple, les titres à statut spécial), tous les Gilts libellés en GBP et cotés au London Stock Exchange peuvent être inclus dans l'Indice de référence. Il n'existe en particulier aucune contrainte liée à l'échéance : les nouvelles émissions sont incorporées le jour ouvré suivant leur adjudication, syndication ou placement. Les Gilts sont retirés à leur date de remboursement.

Les fonds d'État à statut spécial (« Rump Gilts ») sont des Gilts dont l'encours nominal déclaré par

l'Agence en charge de la gestion de la dette britannique (Debt Management Office ou « DMO ») est relativement faible.

Le poids relatif de chaque obligation de l'Indice de référence est déterminé en fonction du rapport entre son encours nominal et l'encours nominal total de l'univers sélectionné.

La composition de l'Indice de référence est repondérée dès lors qu'un événement susceptible d'affecter l'indice survient (par ex., une nouvelle émission ou le remboursement d'une émission).

Les prix des obligations servant à déterminer le cours de clôture de l'Indice de référence sont ceux de la méthodologie de l'indice disponible sur le site www.ftse.com.

L'Indice de référence du Compartiment est l'indice FTSE Actuaries UK Conventional Gilts All Stocks, libellé en GBP. L'Indice de référence est un indice de « rendement total » (les coupons détachés des composantes de l'indice sont réinvestis dans celui-ci).

L'Indice de référence est administré et géré par FTSE Russell.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice : www.ftse.com.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse www.ftse.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent s'exposer aux principaux segments du marché des emprunts d'État britanniques libellés en GBP.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des renseignements supplémentaires sur la valeur liquidative indicative d'une action cotée en Bourse peuvent, sous réserve des conditions et limites imposées par l'exploitant du marché en question, être fournis sur le site Internet du marché réglementé sur lequel cette action est cotée. Ces renseignements sont aussi disponibles sur la page dédiée à l'action en question sur Reuters ou Bloomberg. Des informations supplémentaires sur les codes Bloomberg et Reuters correspondant à la valeur liquidative indicative de toute catégorie d'actions cotées sur une Bourse figurent aussi dans la section Fiches techniques du site Internet www.amundiETF.com.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à

l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions Risque lié au calcul de l'Indice.

Tous les droits de l'Indice de référence appartiennent à FTSE. « FTSE® » est une marque déposée de LSEG et est utilisée sous licence par FTSE.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est en aucune façon garanti, recommandé, vendu ou promu par FTSE International Limited (« FTSE ») ou les sociétés du London Stock Exchange Group (« LSEG ») (collectivement, les « Parties associées au Concédant ») et aucune Partie associée au Concédant ne formule la moindre affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie de quelque sorte que ce soit, expresse ou tacite, à l'égard (i) des résultats qui seront obtenus en utilisant l'Indice de référence (sur lequel se fonde le Compartiment), ni (ii) du chiffre indiquant le niveau de l'Indice de référence à une date ou heure donnée non plus qu'à un autre sujet, ni sur (iii) la pertinence de l'Indice de référence au regard de la finalité de son utilisation dans le cadre du Compartiment. Aucune des Parties associées au Concédant n'a fourni ni ne fournira de conseil financier ou de conseil en investissement ni de recommandation concernant l'Indice de référence à la Société de gestion ou à ses clients.

L'Indice de référence est calculé par FTSE ou son agent. Aucune des Parties associées au Concédant ne sera (a) responsable (que ce soit par négligence ou autrement) envers quiconque de toute erreur dans l'Indice de référence ou (b) dans l'obligation d'informer quiconque de toute erreur à cet égard.

ANNEXE 26

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi UK Government Inflation-Linked Bond

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le GBP.

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi UK Government Inflation-Linked Bond** est de refléter la performance de l'indice FTSE Actuaries UK Index-Linked Gilts All Stocks (l'« **Indice de référence** ») libellé en livres sterling (GBP), représentatif des emprunts d'État britanniques indexés sur l'inflation (« Gilts indexés sur l'inflation ») libellés en GBP, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence fait partie de la famille d'indices FTSE Actuaries UK Gilt, laquelle représente le marché des emprunts d'État britanniques.

Le fait que les Gilts soient indexés sur l'inflation signifie que les paiements du coupon et celui du principal lors du remboursement sont ajustés de façon à tenir compte de l'inflation accumulée, en fonction de l'évolution de l'indice des prix de détail (IPD) au Royaume-Uni depuis la date d'émission des Gilts.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

Hormis certaines catégories, (par exemple, les Gilts convertibles indexés sur l'inflation disposant d'options de conversion en cours et les titres à statut spécial), tous les Gilts indexés sur

l'inflation libellés en GBP et cotés au London Stock Exchange peuvent être inclus dans l'Indice de référence. Il n'existe en particulier aucune contrainte liée à l'échéance : les nouvelles émissions sont incorporées le jour ouvré suivant leur adjudication, syndication ou placement. Les Gilts indexés sur l'inflation sont retirés à leur date de remboursement.

Les fonds d'État à statut spécial (« Rump Gilts ») sont des Gilts dont l'encours nominal déclaré par l'Agence en charge de la gestion de la dette britannique (Debt Management Office ou « DMO ») est relativement faible.

Les prix des obligations servant à déterminer le cours de clôture de l'Indice de référence sont ceux de la méthodologie de l'indice disponible sur le site www.ftse.com.

L'Indice de référence du Compartiment est l'indice FTSE Actuaries UK Index-Linked Gilts All Stocks, libellé en GBP. L'Indice de référence est un indice de « rendement total » (les coupons détachés des composantes de l'indice sont réinvestis dans celui-ci).

L'Indice de référence est administré et géré par FTSE Russell.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composants sont disponibles sur le site Internet à l'adresse : www.ftse.com.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse www.ftse.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent s'exposer à la performance des principales obligations souveraines britanniques indexées sur l'inflation libellées en GBP.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,15 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque spécifique en raison de la saisonnalité et de la poursuite de l'inflation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels

risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est en aucune façon garanti, recommandé, vendu ou promu par FTSE International Limited (« **FTSE** ») ou les sociétés du London Stock Exchange Group (« **LSEG** ») (collectivement, les « **Parties associées au Concédant** ») et aucune Partie associée au Concédant ne formule la moindre affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie de quelque sorte que ce soit, expresse ou tacite, à l'égard (i) des résultats qui seront obtenus en utilisant l'Indice de référence (sur lequel se fonde le Compartiment), ni (ii) du chiffre indiquant le niveau de l'Indice de référence à une date ou heure donnée non plus qu'à un autre sujet, ni sur (iii) la pertinence de l'Indice de référence au regard de la finalité de son utilisation dans le cadre du Compartiment. Aucune des Parties associées au Concédant n'a fourni ni ne fournira de conseil financier ou de conseil en investissement ni de recommandation concernant l'Indice de référence à la Société de gestion ou à ses clients.

L'Indice de référence est calculé par FTSE ou son agent. Aucune des Parties associées au Concédant ne sera (a) responsable (que ce soit par négligence ou autrement) envers quiconque de toute erreur dans l'Indice de référence ou (b) dans l'obligation d'informer quiconque de toute erreur à cet égard.

Tous les droits de l'Indice de référence appartiennent à FTSE. « FTSE® » est une marque déposée de LSEG et est utilisée sous licence par FTSE.

ANNEXE 27

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 7-10Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Treasury Bond 7-10Y** est de refléter la performance du Bloomberg Barclays US Treasury 7-10 Year Index (ci-après l'« **Indice de référence** ») libellée en USD et représentative des « Obligations du Trésor » des États-Unis, avec une échéance résiduelle allant de 7 à 10 ans (exclus), tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Erreur de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence offre une exposition aux bons du Trésor américain à taux fixe dont les échéances résiduelles sont comprises entre 7 et 10 ans (non inclus).

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire, calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'Indice de référence mesure la performance du marché des obligations d'État américaines. Seules les obligations libellées en USD émises par le gouvernement américain et dont l'échéance résiduelle est comprise entre 7 et 10 ans (non inclus) sont incluses.

L'Indice de référence est un indice de rendement total. Un indice de rendement total calcule la

performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres

OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est disponible pour tous les investisseurs.

Les investisseurs de ce Compartiment cherchent une exposition à la performance des principaux segments du marché obligataire à long terme libellés en USD, et en particulier du marché des bons du Trésor américain.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment émet des Actions UCITS ETF. Les Actions UCITS ETF seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions UCITS ETF ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque spécifique en raison de la saisonnalité et de la poursuite de l'inflation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux

Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci .

ANNEXE 28

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi UK Government Bond 0-5Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le GBP.

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement du **MULTI UNITS LUXEMBOURG - Amundi UK Government Bond 0-5Y** consiste à refléter la performance du FTSE Actuaries UK Conventional Gilts Up To 5 Years index (ci-après l'« **Indice de référence** »), libellé en GBP, et représentatif des obligations d'État britannique (« Gilts ») dont l'échéance résiduelle est de maximum 5 ans, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Erreur de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence du Compartiment est le FTSE Actuaries UK Conventional Gilts Up To 5 Years index, libellé en GBP. L'Indice de référence est un indice de « rendement total » (c'est-à-dire que tous les coupons détachés des composantes de l'Indice de référence sont réinvestis dans l'Indice de référence).

L'Indice de référence est composé de titres dont l'échéance est de maximum 5 ans et qui appartiennent à la famille d'indices conventionnelle du FTSE Actuaries UK Gilts Index Series, qui comprend tous les Titres du gouvernement britannique cotés à la Bourse de Londres.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

Excepté pour certaines catégories (par ex. les Gilts convertibles et les actions « rump »), tous

les Gilts libellés en GBP dont l'échéance est de maximum 5 ans et qui sont cotés à la Bourse de Londres sont éligibles à l'inclusion dans l'Indice de référence.

Un Gilt est inclus dans l'Indice de référence soit le jour ouvrable suivant la vente aux enchères s'il a une échéance à émission de maximum 5 ans, soit après la clôture du jour ouvrable lorsque sa date de rachat est d'exactement 5 ans à compter de la date de calcul. Les Gilts sont retirés de l'Indice de référence à leur date de rachat au cours de clôture de la veille.

Les « Rump Gilts » sont des Gilts relativement petits (en termes d'encours nominal) selon la déclaration du Debt Management Office (« DMO »).

La pondération de chaque obligation dans l'Indice de référence est déterminée par son encours nominal par rapport à l'encours nominal total de l'univers sélectionné. L'Indice de référence est rééquilibré chaque fois qu'un événement pertinent se produit (par ex. une nouvelle émission ou le rachat d'une émission).

La source du prix des obligations utilisée pour déterminer le prix de clôture de l'Indice de référence est indiquée dans la méthodologie de l'indice disponible sur www.ftse.com.

L'Indice de référence est administré et géré par FTSE Russell.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice : www.ftse.com.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse www.ftse.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la

partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est disponible pour tous les investisseurs

Les investisseurs de ce Compartiment cherchent une exposition à la performance d'obligations d'État britannique à 5 ans maximum libellées en GBP.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à

l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,10 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment.

De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section du présent Prospectus intitulée Politique de distribution.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est en aucune façon garanti, recommandé, vendu ou promu par FTSE International Limited (« **FTSE** ») ou les sociétés du London Stock Exchange Group (« **LSEG** ») (collectivement, les « **Parties associées au Concédant** ») et aucune Partie associée au Concédant ne formule la moindre affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie de quelque sorte que ce soit, expresse ou tacite, à l'égard (i) des résultats qui seront obtenus en utilisant l'Indice de référence (sur lequel se fonde le Compartiment), ni (ii) du chiffre indiquant le niveau de l'Indice de référence à une date ou heure donnée non plus qu'à un autre sujet, ni sur (iii) la pertinence de l'Indice de référence au regard de la finalité de son utilisation dans le cadre du Compartiment. Aucune des Parties associées au Concédant n'a fourni ni ne fournira de conseil financier ou de conseil en investissement ni de recommandation concernant l'Indice de référence à la Société de gestion ou à ses clients. L'Indice de référence est calculé par FTSE ou son agent. Aucune des Parties associées au Concédant ne sera (a) responsable (que ce soit par négligence ou autrement) envers quiconque de toute erreur dans l'Indice de référence ou (b) dans l'obligation d'informer quiconque de toute erreur à cet égard.

Tous les droits de l'Indice de référence appartiennent à FTSE. « FTSE® » est une marque déposée de LSEG et est utilisée sous licence par FTSE.

ANNEXE 29

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US TIPS Government Inflation-Linked Bond

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US TIPS Government Inflation-Linked Bond** est de refléter la performance de l'indice Barclays US Government Inflation-Linked Bond (l'« **Indice de référence** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), afin de procurer une exposition au marché des titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (TIPS).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est représentatif de la performance des titres du Trésor américain protégés contre l'inflation dont l'échéance finale est à au moins un an.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

Pour pouvoir être incluse dans l'Indice de référence, une obligation doit satisfaire à des critères spécifiques qui ont trait à son type (le principal et les intérêts doivent être indexés sur l'inflation et libellés en USD), à son échéance finale (elle doit être fixée à un an ou plus), à son encours (d'un montant minimum de 500 millions d'USD non ajusté en fonction d'une indexation sur l'inflation), à ses coupons (à taux fixe uniquement) et à son émetteur (le Trésor américain).

L'Indice de référence est pondéré par la valeur de marché.

Il est établi sur la base des prix provenant des teneurs de marché de Barclays et de sources tierces.

L'Indice de référence est calculé quotidiennement.

L'Indice de référence est construit, administré et géré par Barclays.

La composition de l'Indice de référence est révisée et repondérée le dernier jour calendaire du mois.

L'Indice de référence est un indice de « rendement total » (les coupons détachés des composantes de l'indice sont réinvestis dans celui-ci).

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <https://index.barcap.com>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur : <https://index.barcap.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux bons du Trésor américain indexés sur l'inflation.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte

pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,30 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Capital à risque, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque spécifique en raison de la saisonnalité et de la poursuite de l'inflation, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Barclays Bank PLC ou Barclays Capital Inc. et ses sociétés affiliées (ci-après « Barclays ») n'ont pas créé ou émis le Compartiment et Barclays n'a aucune responsabilité, obligation ou devoir envers les investisseurs du Compartiment.

L'indice Barclays US Government Inflation-Linked Bond est une marque commerciale de Barclays Bank PLC et est utilisé sous licence accordée à Amundi Asset Management, qui est l'émetteur du Compartiment. Bien que Amundi Asset Management ait la faculté de conclure en son nom des transactions avec Barclays en lien avec le Compartiment qui sont directement ou indirectement liées à l'indice Barclays US Government Inflation-Linked Bond, l'achat d'actions du Compartiment d'Amundi Asset Management ne confèrera jamais aux investisseurs un droit sur l'indice Barclays US Government Inflation-Linked Bond, non plus que ces derniers n'engagent une quelconque relation avec Barclays par le simple fait qu'ils ont investi dans ce Compartiment. Le compartiment n'est ni parrainé, agréé, commercialisé ou promu par Barclays qui ne fait aucune déclaration de quelque nature que ce soit quant aux avantages qui seront retirés d'un investissement dans le Compartiment, de l'utilisation de l'indice Barclays US Government Inflation-Linked Bond ou des données incorporées dans celui-ci. Barclays ne peut en aucun cas être tenu responsable envers l'émetteur, les investisseurs ou un tiers de l'utilisation ou de l'exactitude de l'indice Barclays US Government Inflation-Linked Bond ou des données qu'il est susceptible de contenir.

ANNEXE 30

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Aggregate Green Bond

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

Le Compartiment a obtenu le label Greenfin.

La devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Aggregate Green Bond** consiste à suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice Solactive Green Bond EUR USD IG (l'« **Indice** ») libellé en euros, afin d'offrir une exposition au marché des obligations vertes, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance des obligations vertes émises par des entités investment grades et libellées en euro et en dollar américain. Les obligations vertes sont émises dans l'objectif de financer des projets ayant un impact environnemental positif, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est pondéré par la valeur de marché, ce qui signifie que les pondérations des composants sont définies en fonction de l'encours de chaque obligation.

L'indice est basé, notamment, sur les prix fournis par Solactive et des sources de prix tierces.

L'Indice est calculé quotidiennement.

L'Indice est compilé, administré et géré par Solactive.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage le dernier jour ouvrable du mois.

La fréquence des rééquilibrages telle que décrite ci-dessus aura une incidence sur les coûts au cours de la réalisation de l'objectif d'investissement. Les frais particuliers générés par ces rééquilibrages de l'Indice incluent les coûts de transaction supplémentaires.

L'Indice est un indice de type « Total Return » (c'est-à-dire que tous les coupons détachés par les composantes de l'Indice sont réinvestis dans ce dernier)

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant le suivi et le rééquilibrage de l'Indice et ses effets sur les coûts de la stratégie) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <https://www.solactive.com>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <https://www.solactive.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché des obligations vertes.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 2 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risque lié aux prêts de titres, Risque lié à une faible diversification, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de marché lié à une controverse, Risque de calcul de l'indice.

LIMITES DE L'APPROCHE EXTRA-FINANCIÈRE

L'approche extra-financière mise en œuvre par le Compartiment repose en grande partie sur des données de tiers qui peuvent être parfois incomplètes, inexactes ou indisponibles. La Société de gestion est donc dépendante de la qualité et de la fiabilité de ces informations. Enfin, les investissements dans les obligations vertes peuvent induire des biais sectoriels sur le marché obligataire mondial.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur Solactive en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans la méthodologie de l'Indice. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations sur la méthodologie de l'Indice, veuillez vous référer à : <https://www.solactive.com>. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni parrainé, promu, vendu ou soutenu de quelque autre manière par Solactive AG. De même, Solactive AG ne donne à aucun moment une quelconque garantie ou assurance, expresse ou tacite, quant aux résultats obtenus en utilisant l'Indice et/ou la marque de l'Indice ou son cours, ou à tout autre égard. L'Indice est calculé et publié par Solactive AG.

Solactive AG fait tout ce qui est en son pouvoir pour que l'Indice soit calculé correctement. Indépendamment de ses obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'a aucune obligation de signaler les erreurs de l'Indice à des tiers, y compris, mais sans s'y limiter, aux investisseurs et/ou aux intermédiaires financiers du Compartiment. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG, ni l'octroi d'une licence portant sur l'Indice ou sa marque en vue de son utilisation aux fins du Compartiment n'a valeur de recommandation d'un investissement dans le Compartiment par Solactive AG, et ils n'impliquent en aucune manière une garantie ou un avis de Solactive AG à l'égard de tout investissement dans le Compartiment.

ANNEXE 31

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi FTSE Italia All Cap PIR 2020

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi FTSE Italia All Cap PIR 2020** est de répliquer l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice FTSE Italia PIR All Cap Net Tax (l'« Indice »), libellé en euros (EUR), qui est représentatif de la performance des actions italiennes de grande, moyenne et petite capitalisation éligibles au « Piano Individuale di Risparmio a lungo termine » (PIR) mis en place avant le 31 décembre 2018 ou à compter du 1er janvier 2020, conformément à la Loi de Finances 2017 italienne (Loi n°232 du 11 décembre 2016), telle que modifiée ou complétée (la « Loi PIR »), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« Écart de suivi »).

Pour les catégories d'actions Daily Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment appliquera également une stratégie de couverture de change quotidienne afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice mesure la performance des actions des sociétés italiennes de petite, moyenne et grande capitalisation éligibles au PIR.

L'Indice comprend toutes les composantes de l'indice FTSE MIB et de l'indice FTSE Italia PIR PMI.

L'indice FTSE MIB mesure la performance des 40 valeurs les plus liquides et les plus fortement capitalisées cotées sur les marchés Mercato Telematico Azionario (MTA) et Mercato telematico degli Investment Vehicles (MIV) de la bourse de Milan (Borsa Italiana).

L'indice FTSE Italia PIR PMI comprend toutes les composantes de l'indice FTSE Italia Mid Cap ainsi que 20 composantes de l'indice FTSE Italia Small Cap, sélectionnées en fonction de leur taille et de leur liquidité.

L'indice FTSE Italia Mid Cap est constitué des 60 principales valeurs classées en fonction de leur capitalisation boursière totale (c'est-à-dire avant toute pondération selon les critères d'investissement) qui ne sont pas incluses dans l'indice FTSE MIB, et qui satisfont par ailleurs aux critères de liquidité et de flottant.

L'indice FTSE Italia Small Cap reflète la performance de toutes les autres actions de petites capitalisations qui ne figurent pas dans l'indice FTSE MIB ou dans l'indice FTSE Italia Mid Cap et qui satisfont par ailleurs aux critères de liquidité et de flottant.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice comprend toutes les composantes des indices FTSE MIB et FTSE Italia PIR PMI.

L'Indice est un indice pondéré par la capitalisation boursière corrigée du flottant de chaque composante.

Lors de chaque rééquilibrage, l'Indice fait l'objet d'un double plafonnement visant à assurer sa conformité :

- a) aux exigences

de la Loi PIR, qui impose :

- une pondération minimum de 3,5 % (portée par prudence à 5 %) pour les entreprises qui ne sont pas incluses dans l'indice FTSE MIB ou l'indice FTSE Italia Mid Cap ;
- une pondération minimum de 21 % (portée par prudence à 25 %) pour les entreprises qui ne sont pas incluses dans l'indice FTSE MIB ;

- b) aux limites de concentration applicables aux OPCVM, qui prévoient que la pondération d'une action ne peut excéder 10 % et que l'ensemble des actions dont la pondération est supérieure à 5 % ne peut excéder 40 %.

L'Indice est administré et géré par FTSE Russell.

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet suivant : www.ftserussell.com.

La composition de l'Indice sera repondérée tous les trimestres (en mars, juin, septembre et décembre).

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère selon lequel tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

• **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet www.ftserussell.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Les Actions du Compartiment sont incluses dans la liste des investissements éligibles au plan d'épargne individuel à long terme « Piano Individuale di Risparmio a lungo termine » (PIR), mis en place avant le 31 décembre 2018 ou à compter du 1er janvier 2020, conformément à la Loi de Finances 2017 italienne (Loi n°232 du 11 décembre 2016), telle que modifiée ou complétée.

Le Compartiment investira un minimum de 70 % du portefeuille dans des instruments financiers, qu'ils soient négociés sur un Marché réglementé ou sur un système de négociation multilatérale, émis ou contractés par des sociétés résidentes en Italie, ou dans un État membre de l'UE ou de l'EEE et établies de manière permanente en Italie.

Un minimum de 25 % de ces instruments financiers (ce qui correspond à 17,5 % du portefeuille du Compartiment) doit être émis par des sociétés qui ne figurent pas dans l'indice FTSE MIB ou tout indice équivalent, et un minimum de 5 % supplémentaire de ces instruments financiers (ce qui correspond à 3,5 % du portefeuille du Compartiment) doit être émis par des sociétés qui ne figurent pas dans les indices FTSE MIB et FTSE Mid Cap ou tout indice équivalent.

Le Compartiment ne peut pas investir plus de 10 % du portefeuille dans des instruments financiers émis ou contractés par la même société, ou par des sociétés appartenant au même groupe, ou dans des dépôts en espèces

Le Compartiment n'est pas autorisé à investir dans des instruments financiers émis par des sociétés qui ne résident pas dans des pays permettant un échange de renseignements adéquat avec l'Italie.

Comme le requiert la Loi PIR, afin que le Compartiment soit considéré conforme à ses dispositions pendant une année civile complète, ces restrictions d'investissement doivent être respectées pendant au moins les deux tiers de chaque année civile à compter du 1^{er} janvier 2020.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent s'exposer à la performance du marché actions italien.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. En conséquence, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation auprès d'au moins un teneur de marché qui prendra des mesures pour faire en sorte que le cours de Bourse des Actions ne s'écarte pas sensiblement de leur Valeur liquidative telle qu'elle est définie plus haut.

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,08 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLI des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risques liés à l'investissement dans des actions de moyenne capitalisation, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est en aucune façon parrainé, recommandé, commercialisé ou promu par FTSE International Limited (ci-après « FTSE ») ou les sociétés du London Stock Exchange Group (« LSEG ») (collectivement, les « Parties associées au Concédant ») et aucune Partie associée au Concédant ne formule la moindre affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie de quelque sorte que ce soit, expresse ou tacite, à l'égard (i) des résultats qui seront obtenus en utilisant l'Indice (sur lequel se fonde le Compartiment), ou (ii) du chiffre indiquant le niveau de l'Indice à une date ou

heure donnée, ou (iii) de la pertinence de l'Indice au regard de la finalité de son utilisation dans le cadre de la gestion du Compartiment. Aucune des Parties associées au Concédant n'a fourni ni ne fournira de conseil financier ou de conseil en investissement ni de recommandation concernant l'Indice à la Société de gestion ou à ses clients. L'Indice est calculé par FTSE ou par son agent. Aucune Partie associée au Concédant (a) ne pourra être tenue responsable (que ce soit par négligence ou pour toute autre raison) à l'égard de quiconque pour toute erreur dans l'Indice ou (b) n'aura d'obligation d'en informer quiconque.

Tous les droits sur l'Indice sont dévolus à FTSE. « FTSE® » est une marque de LSEG utilisée par FTSE sous licence.

ANNEXE 32

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI EMU

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI EMU** est de répliquer l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI EMU Net Return (l'« **Indice** ») libellé en euros (EUR), représentatif de la performance des sociétés de grande et moyenne capitalisation cotées sur les marchés développés de l'Union économique et monétaire européenne (UEM), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un est un indice pondéré par la capitalisation boursière flottante, conçu pour mesurer la performance des segments grandes et moyennes capitalisations sur les marchés des pays développés de l'UEM.

L'Indice a comme objectif de représenter 85 % de la capitalisation boursière ajustée du flottant de chaque pays et de chaque secteur d'activité au sein de l'UEM.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices international MSCI.

L'Indice repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices, qui prend en compte la taille, la liquidité et le flottant minimal requis pour les valeurs faisant partie de l'univers d'investissement.

L'Indice représente les grandes et moyennes capitalisations issues des pays développés de l'UEM (en février 2017, la zone inclut les pays suivants : l'Allemagne, l'Autriche, la Belgique, l'Espagne, la Finlande, la France, l'Irlande, l'Italie, les Pays-Bas et le Portugal).

En visant 85 % de chaque pays et de chaque groupe d'industries, l'Indice capture ainsi 85 % de la capitalisation boursière totale des marchés de l'UEM, tout en reflétant la diversité économique de ces marchés.

La méthodologie MSCI et la méthode de calcul sont basées sur un nombre variable de sociétés de l'Indice.

L'Indice de référence est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et

restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA), ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à la performance des valeurs de grande et moyenne capitalisation des pays développés de l'UEM.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités

à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

Ce droit est plafonné à 0,03 % pour les Classes Acc et Dist.

Ce droit est plafonné à 0,05 % pour les Classes Monthly Hedged to USD - Acc, Monthly Hedged to USD - Dist, Monthly Hedged to GBP - Acc, Monthly Hedged to GBP - Dist, Monthly Hedged to CHF - Acc et Monthly Hedged to CHF - Dist.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ou une quelconque filiale de MSCI, ou l'une quelconque des entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement ou le calcul des indices MSCI, ne fait aucune déclaration et n'émet aucune garantie, expresse ou implicite, vis-à-vis des détenteurs de parts du Fonds ou plus généralement du public, quant à l'opportunité d'une transaction sur des parts de fonds en général, ou les parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à répliquer la performance du marché actions international. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI

sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Fonds. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI, n'est tenu de prendre en considération les besoins de Amundi Asset Management ou des détenteurs de parts du Fonds pour déterminer, composer ou calculer les indices MSCI. Ni MSCI, ni l'une quelconque des filiales de MSCI, ni l'une quelconque des entités participant à la production des indices MSCI ne prend une quelconque décision concernant la date de lancement, la fixation du prix ou de la quantité d'unités du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour déterminer la valeur liquidative du Compartiment.

Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI, n'endosse aucune responsabilité ni obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Fonds.

Bien que MSCI obtienne des informations intégrées ou utilisées dans le calcul des indices de la part de sources que MSCI considère comme fiables, ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création ou le calcul des indices MSCI ne garantit l'exactitude et/ou la nature exhaustive des indices ou de toute donnée incluse. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les actionnaires du compartiment ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 33

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 1-3Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 1-3Y** consiste à refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 1-3 Year Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 1-3 Year Bond procure une exposition aux emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis par les pays membres de l'Union Monétaire Européenne. Il contient des obligations libellées en euro dont l'échéance est d'au moins un an, mais inférieure à trois ans.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire qui est calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 1-3 Year Bond mesure la performance des obligations d'État investment grade de la zone euro. Il contient exclusivement des obligations libellées en euro assorties d'une échéance d'au moins un an, mais inférieure à trois ans.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que

les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs privés et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux obligations émises par les États membres de la zone euro ayant une maturité comprise entre 1 et 3 ans.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

- 0,07 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées au titre des Catégories d'actions Monthly Hedged ;
- 0,05 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les autres Catégories d'actions.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, **Risque lié aux prêts de titres**, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment.

De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 34

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 3-5Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 3-5Y** consiste à refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 3-5 Year Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 3-5 Year Bond procure une exposition aux emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis par les pays membres de l'Union Monétaire Européenne. Il contient des obligations libellées en euro dont l'échéance est d'au moins trois ans, mais inférieure à cinq ans.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire qui est calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 3-5 Year Bond mesure la performance des obligations d'État investment grade de la zone euro. Il contient exclusivement des obligations libellées en euro assorties d'une échéance d'au moins trois ans, mais inférieure à cinq ans.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que

les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux titres obligataires émis par les États membres de la zone euro ayant une maturité comprise entre 3 et 5 ans.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

- 0,07 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées au titre des Catégories d'actions Monthly Hedged ;
- 0,05 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les autres Catégories d'actions.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, **Risque lié aux prêts de titres**, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc, (conjointement avec ses sociétés affiliées « Barclays »), concédée sous licence. Bloomberg ou les concédants de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les indices Bloomberg et Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 35

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 10-15Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond 10-15Y** consiste à refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 10-15 Year Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 10-15 Year Bond procure une exposition aux emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis par les pays membres de l'Union Monétaire Européenne. Il contient des obligations libellées en euro dont l'échéance est d'au moins dix ans, mais inférieure à quinze ans.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire qui est calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 10-15 Year Bond mesure la performance des obligations d'État investment grade de la zone euro. Il contient exclusivement des obligations libellées en euro assorties d'une échéance d'au moins dix ans, mais inférieure à quinze ans.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que

les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux titres obligataires émis par les États membres de la zone euro ayant une maturité comprise entre 10 et 15 ans.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

- 0,12 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées au titre des Catégories d'actions Monthly Hedged ;
- 0,10 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les autres Catégories d'actions.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, **Risque lié aux prêts de titres**, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent en aucun cas l'actualité, l'exactitude ou l'exhaustivité des données ou informations relatives à l'Indice, et ne sauraient être tenus responsables envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou d'autres tiers de l'utilisation ou de l'exactitude de l'Indice de référence ou de toute donnée y figurant.

ANNEXE 36

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond II

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Bond** consiste à refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,30 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn Bond procure une exposition aux emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis par les pays membres de l'Union Monétaire Européenne. Il contient des obligations libellées en euro dont l'échéance est supérieure à 1 an.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire qui est calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn Bond mesure la performance des obligations d'État investment grade de la zone euro. Il contient exclusivement des obligations libellées en euro.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs privés et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux titres obligataires émis par les États membres de la zone euro couvrant l'ensemble des maturités.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

- 0,12 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées au titre des Catégories d'actions Monthly Hedged ;
- 0,10 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les autres Catégories d'actions.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, **Risque lié aux prêts de titres**, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 37

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Inflation-Linked Bond

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Inflation-Linked Bond** consiste à refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'indice Bloomberg Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond procure une exposition aux obligations indexées sur l'inflation de qualité investment grade émises par les pays membres de l'Union Monétaire Européenne. Il contient des obligations indexées sur l'inflation libellées en euro.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice obligataire qui est calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

L'indice Bloomberg Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond mesure la performance des obligations d'État indexées sur l'inflation de la zone euro de qualité investment grade. Il contient exclusivement des obligations libellées en euro.

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus aura un impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. Les coûts particuliers encourus à la suite d'un tel rééquilibrage de l'Indice de référence comprennent des coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice de référence.

Une description exhaustive de l'Indice de référence et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

- **Informations complémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à

des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs privés et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux obligations indexées sur l'inflation émises par les États membres de la zone euro.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

- 0,12 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées au titre des Catégories d'actions Monthly Hedged ;

- 0,10 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les autres Catégories d'actions.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risque des instruments liés à l'inflation, Risque spécifique en raison de la saisonnalité et de la poursuite de l'inflation, Risque lié aux prêts de titres, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays.

Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 38

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi FTSE 100

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est la livre sterling (GBP).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de MULTI UNITS LUXEMBOURG – **Amundi FTSE 100** consiste à répliquer, à la hausse comme à la baisse, l'indice FTSE 100 Total Return Index (l'« **Indice** ») libellé en livres sterling (GBP), afin de procurer une exposition aux performances des 100 plus grandes sociétés cotées sur la bourse London Stock Exchange, filtrées par taille et par liquidité, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,05 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice se compose d'actions des 100 plus grandes sociétés cotées sur le London Stock Exchange qui satisfont aux critères d'éligibilité de FTSE. L'Indice est un indice pondéré par la capitalisation boursière représentatif des valeurs vedettes (« blue chips ») cotées au Royaume-Uni.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'univers d'investissement éligible de l'Indice se compose de titres qui satisfont aux critères suivants :

- (i) Il comprend uniquement des actions inscrites et admises à la négociation sur le marché principal du London Stock Exchange par la voie du « Premium Listing » et dont le cours est libellé en livre sterling sur le système de transaction électronique SETS.

- (ii) Les titres éligibles satisfont aux critères de liquidité et de flottant décrits dans la méthodologie des indices FTSE.
- (iii) Les sociétés sont classées comme sociétés britanniques selon la méthodologie de FTSE.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composants sont disponibles sur le site Internet de FTSE à l'adresse www.ftse.com.

La performance suivie est celle des valeurs de clôture de l'Indice calculées par FTSE au moyen du système WM/Reuters Spot Rates™ à 16 h 00 (heure du Royaume-Uni).

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet www.ftse.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à la performance des grandes capitalisations au Royaume-Uni.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en

remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1,00 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par action sera disponible au siège de la Société et publiée sur www.fundsquare.net.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une Classe, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par FTSE International Limited (ci-après « **FTSE** »), ni par aucune société du London Stock Exchange Group (« **LSEG** ») (ci-après collectivement désignés les « **Détenteurs** »).

Les Porteurs ne fournissent aucune garantie et ne s'engagent pas, de manière explicite ou implicite, quant au revenu à obtenir en utilisant le FTSE 100 Total Return Index et/ou le niveau que l'Indice peut atteindre à une heure ou une date donnée, ou de tout autre type. L'Indice est calculé par FTSE et LSEG ou pour leur compte. Les Porteurs déclinent toute responsabilité (qu'elle soit due à une négligence ou à toute autre raison) pour toute erreur susceptible d'affecter négativement l'Indice à l'égard de quiconque et ne seront pas tenus d'informer quiconque d'une telle erreur.

« FTSE® » est une marque déposée de LSEG utilisée sous licence par FTSE.

ANNEXE 39

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World V

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI World V** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI World Net Total Return USD (l'« **Indice** ») libellé en dollars des États-Unis, représentatif de la performance de sociétés de grande et moyenne capitalisation cotées sur les marchés développés, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant qui est conçu pour mesurer la performance des segments grandes et moyennes capitalisations des marchés développés du monde entier.

L'Indice a comme objectif de représenter 85 % de la capitalisation boursière ajustée du flottant de chaque pays au sein de l'Indice.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices international MSCI.

L'Indice repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices, qui prend en compte la taille, la liquidité et le flottant minimal requis pour les valeurs faisant partie de l'univers d'investissement.

L'Indice se compose exclusivement d'actions des marchés développés et représente les grandes et moyennes capitalisations issues des marchés développés du monde entier (dont la liste se compose, en décembre 2017, des pays suivants : Australie, Autriche, Belgique, Canada, Danemark, Finlande, France, Allemagne, Hong Kong, Irlande, Israël, Italie, Japon, Pays-Bas, Nouvelle-Zélande, Norvège, Portugal, Singapour, Espagne, Suède, Suisse, Royaume-Uni et États-Unis).

En visant 85 % de chaque pays, l'Indice capture ainsi 85 % de la capitalisation boursière totale des pays développés, tout en reflétant la diversité économique de ces marchés.

La méthodologie MSCI et la méthode de calcul sont basées sur un nombre variable de sociétés de l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <https://www.msci.com/indexes>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à long terme à la performance du marché des actions des pays développés du monde entier.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées

tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,05 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ou une quelconque filiale de MSCI, ou l'une quelconque des entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit

l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récusé toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 40

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Japan

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le yen japonais (JPY).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement du MULTI UNITS LUXEMBOURG – **Amundi MSCI Japan** (le « **Compartiment** ») consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du MSCI Japan Net Total Return Index (l'« **Indice** »), libellé en JPY, et représentatif des sociétés de grande et de moyenne capitalisation cotées au Japon, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Erreur de suivi** »).

Pour les catégories d'actions couvertes mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1,00 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière ajustée au flottant conçu pour mesurer la performance des segments de grande et de moyenne capitalisation du marché japonais.

L'objectif de l'Indice est de représenter 85 % de la capitalisation boursière ajustée au flottant du marché japonais.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices international MSCI.

L'Indice est basé sur la méthodologie du MSCI Global Investable Market Indices et répond aux critères de taille, de liquidité et de flottant minimum de l'univers d'investissement.

L'Indice est composé d'actions japonaises et reflétera 85 % de la capitalisation boursière totale du marché japonais.

La méthodologie MSCI et la méthode de calcul sont basées sur un nombre variable de sociétés de l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <https://www.msci.com/indexes>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

LE GESTIONNAIRE D'INVESTISSEMENT

La Société de Gestion a nommé Amundi Japan Ltd en tant que Gestionnaire d'investissement du Compartiment (le « Gestionnaire d'investissement ») en vertu de la Convention de délégation de gestion d'investissement (la « Convention »).

Amundi Japan Ltd est une société anonyme constituée au Japon dont le siège social est sis au 1-2-2 Uchisaiwaicho, Chiyoda-ku, Tokyo 100-0011.

En vertu de la présente Convention, le Gestionnaire d'investissement a accepté de mettre en œuvre l'objectif et la politique d'investissement décrits ci-dessus.

La Société de Gestion versera au Gestionnaire d'investissement une commission prélevée sur la Commission de gestion du Compartiment.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent une exposition de base et à long terme à la performance de sociétés de grande et moyenne capitalisation du marché japonais.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités

à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

- 0,06 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les Catégories d'actions Daily Hedged ;
- 0,04 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les autres Catégories d'actions.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation,

Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ou une quelconque filiale de MSCI, ou l'une quelconque des entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités

impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récite toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 41

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Asia II

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Asia II** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI Emerging Markets Asia Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), représentatif de la performance de sociétés de grande et moyenne capitalisation cotées sur les marchés émergents asiatiques, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant qui est conçu pour mesurer la performance des segments grandes et moyennes capitalisations des marchés émergents asiatiques.

L'Indice a comme objectif de représenter 85 % de la capitalisation boursière ajustée en fonction du flottant de chaque pays émergent asiatique.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices international MSCI.

L'Indice repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices, qui prend en compte la taille, la liquidité et le flottant minimal requis pour les valeurs faisant partie de l'univers d'investissement.

L'Indice se compose exclusivement d'actions du marché émergent asiatique et représente les grandes et moyennes capitalisations de pays dudit marché émergent asiatique (comprenant, en décembre 2017, les pays suivants : La Chine, l'Inde, l'Indonésie, la Corée, la Malaisie, le Pakistan, les Philippines, Taïwan et la Thaïlande).

La méthodologie MSCI et la méthode de calcul sont basées sur un nombre variable de sociétés de l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à la performance des grandes et moyennes capitalisations sur les marchés émergents asiatiques.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte

pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur <http://www.amundiETF.com>.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'Annexe C – Prise en compte des risques spécifiques et facteurs de risques, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. Ce Compartiment est considérablement exposé aux régions qui peuvent avoir une surveillance gouvernementale ou réglementaire relativement faible ou une transparence ou une divulgation moindre des Facteurs de durabilité et peut donc être soumis à des Risques accrus en matière de durabilité. De plus amples informations sont disponibles à la section du Prospectus intitulée « PUBLICATION

D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ ».

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Aucune distribution ne sera effectuée pour les Actions des Classes Acc.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont

MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées.

Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 42

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core UK Equity All Cap (DR) UCITS ETF

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est la livre sterling (GBP).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core UK Equity All Cap (DR) UCITS ETF** (le « Compartiment ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice Morningstar UK NR (l'« **Indice** ») libellé en livres sterling (GBP), représentatif de la performance des sociétés de grande et moyenne capitalisation cotées sur le marché du Royaume-Uni, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant qui est conçu pour mesurer la performance du marché des actions de grandes et moyennes capitalisations au Royaume-Uni.

L'Indice a comme objectif de représenter 97 % de la capitalisation boursière ajustée en fonction du flottant du Royaume-Uni.

- **Méthodologie de l'Indice**

Il s'agit d'un indice d'actions sponsorisé par le fournisseur d'indices internationaux Morningstar.

L'Indice se compose exclusivement d'actions du marché actions du Royaume-Uni et représente les grandes et moyennes capitalisations dudit marché.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de Morningstar à l'adresse suivante : <http://www.morningstar.com>.

La composition de l'Indice est repondérée tous les trimestres, en février, mai, août et novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est également calculé en temps réel chaque Jour de négociation si celui-ci est un Jour ouvré.

Le cours de clôture de l'Indice est disponible sur le site Internet : <http://www.morningstar.com/>

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.morningstar.com/>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition principale à long terme à la performance du marché des actions de grandes et moyennes capitalisations au Royaume-Uni.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans

le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,04 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Des informations sur la VLi d'une action négociée en bourse sont fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » du Prospectus et à la section « Informations pratiques » du DICI.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

La Société se réserve le droit de distribuer une ou plusieurs fois par an tout ou partie des revenus du Compartiment, en ce qui concerne la Catégorie Dist.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le compartiment n'est ni parrainé, recommandé, commercialisé ou promu par Morningstar, Inc. Morningstar s'abstient de toute déclaration et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires du Compartiment ou à un quelconque membre du public quant à l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le fonds en particulier, ou quant à la capacité de l'Indice Morningstar UK NR à reproduire la performance générale du marché des actions. Le seul lien entre Morningstar et Amundi Asset Management consiste en l'octroi d'une licence concernant : (i) certaines marques et noms de service de Morningstar ; et (ii) l'Indice Morningstar UK NR qui est compilé, composé et calculé par Morningstar sans égard pour Amundi Asset Management et pour le Compartiment. Morningstar n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins de Amundi Asset Management ou des propriétaires du Compartiment lorsqu'il compile, compose ou calcule l'Indice Morningstar UK NR. Morningstar ne peut être tenu pour responsable de, et n'a pas participé à, la détermination des prix et de la valeur du Compartiment, non plus qu'à la fixation de la date de l'émission ou de la vente - d'actions du Compartiment ou à la détermination ou au calcul de l'équation régissant la conversion du Compartiment en espèces. Morningstar n'est soumis à aucune obligation d'assurer l'administration, la commercialisation ou la négociation du Compartiment et décline toute responsabilité à ce propos.

Morningstar, Inc. ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice Morningstar UK NR, non plus que d'une quelconque donnée qu'il intègre, et Morningstar décline toute responsabilité quant à toute erreur, omission ou interruption affectant cet Indice. Morningstar ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires ou utilisateurs du fonds ou à une quelconque autre personne physique ou morale, quant aux résultats que Amundi Asset Management retirera de l'utilisation de l'Indice Morningstar UK NR ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. Morningstar ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, et décline expressément toute garantie quant à la qualité marchande ou l'adéquation à un usage donné ou une finalité particulière de l'Indice Morningstar UK NR ou d'une quelconque donnée incorporée dans celui-ci. Sans préjudice de ce qui précède, Morningstar ne pourra en aucun cas être tenu pour responsable d'un quelconque préjudice du fait de dommages et intérêts spéciaux, indirects ou pour préjudice moral, ou de dommages et intérêts indirects (y compris pour un manque à gagner) même s'il a été avisé de la possibilité de tels dommages.

ANNEXE 43

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core US Equity (DR) UCITS ETF

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core Equity US (DR) UCITS ETF** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'Indice Morningstar US Large-Mid Cap NR (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), représentatif du marché des actions de grande et moyenne capitalisation aux États-Unis, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Daily Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie quotidienne de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant qui est conçu pour mesurer la performance du marché des actions de grande et moyenne capitalisation aux États-Unis.

- **Méthodologie de l'Indice**

Il s'agit d'un indice d'actions sponsorisé par le fournisseur d'indices internationaux Morningstar.

L'Indice se compose exclusivement d'actions du marché actions des États-Unis et représente les grandes et moyennes capitalisations dudit marché.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de Morningstar à l'adresse suivante : <http://www.morningstar.com>.

La composition de l'Indice est repondérée tous les trimestres, en février, mai, août et novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est également calculé en temps réel chaque Jour de négociation si celui-ci est un Jour ouvré.

Le cours de clôture de l'Indice est disponible sur le site Internet : <http://www.morningstar.com/>

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.morningstar.com/>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans

l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition principale à long terme à la performance des actions de grandes et moyennes capitalisations aux États-Unis.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus),

les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

- 0,06 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les Catégories d'actions Daily Hedged.
- 0,04 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées pour les autres Catégories d'actions.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention

des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le compartiment n'est ni parrainé, recommandé, commercialisé ou promu par Morningstar, Inc. Morningstar s'abstient de toute déclaration et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires du Compartiment ou à un quelconque membre du public quant à l'opportunité d'investir dans des titres en général ou dans le fonds en particulier, ou quant à la capacité de l'Indice Morningstar US Large-Mid Cap NR à suivre la performance générale du marché des actions. Le seul lien entre Morningstar et Amundi Asset Management consiste en l'octroi d'une licence concernant : (i) certaines marques et noms de service de Morningstar ; et (ii) l'Indice Morningstar US Large-Mid Cap NR qui est compilé, composé et calculé par Morningstar sans égard pour Amundi Asset Management et pour le Compartiment. Morningstar n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins de Amundi Asset Management ou des propriétaires du - fonds lorsqu'il compile, compose ou calcule l'Indice US Large-Mid Cap NR. Morningstar ne peut être tenu pour responsable de, et n'a pas participé à, la détermination des prix et de la valeur du Compartiment, non plus qu'à la fixation de la date de l'émission ou de la vente - d'actions du Compartiment ou à la détermination ou au calcul de l'équation régissant la conversion du Compartiment en espèces. Morningstar n'est soumis à aucune obligation d'assurer l'administration, la commercialisation ou la négociation du Compartiment et décline toute responsabilité à ce propos.

Morningstar, Inc. ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice Morningstar US Large-Mid Cap NR, non plus que d'une quelconque donnée qu'il intègre, et Morningstar décline toute responsabilité quant à toute erreur, omission ou interruption affectant cet Indice. Morningstar ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, aux propriétaires ou utilisateurs du fonds ou à une quelconque autre personne physique ou morale, quant aux résultats que Amundi Asset Management retirera de l'utilisation de l'Indice Morningstar US Large-Mid Cap NR ou de quelconques données qu'il intègre. Morningstar ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, et décline expressément toute garantie quant à la qualité marchande ou l'adéquation à un usage donné ou une finalité particulière de l'Indice Morningstar US Large-Mid Cap NR ou d'une quelconque donnée incorporée

dans celui-ci. Sans préjudice de ce qui précède, Morningstar ne pourra en aucun cas être tenu pour responsable d'un quelconque préjudice du fait de dommages et intérêts spéciaux, indirects ou pour préjudice moral, ou de dommages et intérêts indirects (y compris pour un manque à gagner), même s'il a été avisé de la possibilité de tels dommages.

ANNEXE 44

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor MSCI World ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor MSCI World ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF** est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI World Select ESG Rating and Trend Leaders Net Return USD (l'« **Indice** »), libellé en dollar des États-Unis (USD), afin de procurer une exposition à la performance des actions de moyenne et de grande capitalisation boursière des marchés développés, émises par des sociétés bien notées en matière de pratiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice représente la performance des valeurs de moyenne et de grande capitalisation boursière, issues de marchés développés, émises par des sociétés bien notées en matière de pratiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) par rapport aux autres acteurs du même secteur et/ou qui ont connu une amélioration annuelle de leur note à cet égard. Les sociétés dont les produits ou activités ont des impacts sociaux ou environnementaux négatifs sont exclues de l'Indice, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage annuels. L'indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels afin de vérifier si les composants respectent toujours les critères d'exclusion.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de son fournisseur à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres

OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs privés et institutionnels souhaitant avoir une exposition à la performance des valeurs, à moyenne comme à forte capitalisation boursière, issues de marchés développés, émises par des sociétés bien notées en matière de pratiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) et/ou qui connaissent une évolution favorable à cet égard.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risques liés à l'investissement dans des valeurs de moyenne capitalisation, Risque lié au prêt de titres, manque de réactivité aux changements de circonstances, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des

garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul des scores ESG, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG de MSCI, veuillez consulter : <http://www.msci.com>. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales dont Amundi Asset Management a acquis la licence à des fins spécifiques. Ni MSCI, ni une quelconque filiale de MSCI, et aucune des entités participant à la production ou au calcul des indices MSCI, n'a fait une quelconque déclaration ni accordé une quelconque garantie, expresse ou tacite, aux détenteurs de parts dans le Compartiment ou, de manière plus générale, au grand public quant à l'opportunité de négocier des parts de fonds d'investissement en général ou des parts de ce Compartiment en particulier, ou quant à la capacité d'un quelconque indice MSCI de reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont détenteurs de certains noms, marques déposées et des indices MSCI qui sont déterminés, composés et calculés par MSCI sans concertation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des

indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 45

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor German Mid-Cap MDAX UCITS ETF

La devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor German Mid-Cap MDAX UCITS ETF** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution à la hausse comme à la baisse de l'indice Mid Cap DAX index (MDAX) (l'« **Indice** ») libellé en euros et représentatif de 50 sociétés anonymes allemandes et sociétés étrangères de taille moyenne ou intermédiaire (« **midcap** »), cotées sur le premier segment de la Deutsche Börse, tout en minimisant la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

Cet indice donne la mesure du cours moyen pondéré de 50 actions de moyennes capitalisations boursières listées sur le premier segment de la Bourse Allemande (Deutsche Boerse).

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice représente la performance des 50 actions de moyennes capitalisations boursières listées sur le premier segment de la Bourse Allemande (Deutsche Boerse), qui suivent les 30 actions du DAX 30 en termes de capitalisation boursière et de liquidité sur le marché.

L'Indice est pondéré par la capitalisation boursière ajustée du flottant, la pondération de chaque composante étant plafonnée à 10 % à chaque rééquilibrage de l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'Indice.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice est révisée tous les ans et rééquilibrée chaque trimestre.

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération

respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet de son concepteur à l'adresse : www.dax-indices.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.dax-indices.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indicatif » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à des sociétés anonymes allemandes et des sociétés étrangères de taille moyenne ou intermédiaire (« midcap »), cotées sur le premier segment de la Deutsche Börse.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,5 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque lié à l'investissement dans des moyennes capitalisations, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Cet instrument financier n'est ni parrainé, ni préconisé, distribué ou soutenu d'aucune autre manière par la Deutsche Börse AG (« le Donneur de licence »). Le Donneur de licence ne donne aucune garantie ou ne fait aucune déclaration explicite ou implicite, ni en ce qui concerne les résultats découlant de l'utilisation de l'Indice et/ou de la marque déposée de l'Indice, ni en ce qui concerne la valeur de l'Indice à un certain moment ou à une certaine date, ni à aucun autre égard. L'Indice est calculé et publié par Concédant de la Licence. Néanmoins, dans la mesure où cela est admissible en vertu de la loi, le Donneur de licence ne répondra pas, vis-à-vis des tiers, d'erreurs potentielles dans l'Indice. En outre, le Donneur de licence n'est pas tenu, vis-

à-vis des tiers, y compris des investisseurs, de signaler les erreurs potentielles figurant dans l'Indice.

Ni la publication de l'Indice par le Donneur de licence, ni la concession d'une licence concernant l'Indice ainsi que la marque déposée de l'Indice pour leur utilisation au sujet de l'instrument financier ou des autres titres ou produits financiers qui proviennent de l'Indice ne représentent une recommandation par le Donneur de licence pour un placement de capitaux ou ne contiennent, de quelque manière que ce soit, une garantie ou une opinion du Donneur de licence au sujet de l'opportunité d'un investissement dans ce produit.

En sa qualité de seul propriétaire de tous les droits afférents à l'Indice et à la marque déposée de l'Indice, le Donneur de licence n'a concédé sous licence à l'émetteur de l'instrument financier que l'utilisation de l'Indice et de la marque déposée de l'Indice, ainsi que de toute référence à l'Indice et à la marque déposée de l'indice au sujet de l'instrument financier.

ANNEXE 46

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI All Country World

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI All Country World** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI AC World Index (ACWI) Net Total Return index (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), représentatif des marchés actions des pays développés et des pays émergents, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré par la capitalisation boursière ajustée du flottant qui a été conçu pour mesurer l'univers investissable et la performance des sociétés des marchés développés et émergents.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice a été conçu pour couvrir les grandes et moyennes capitalisations et il est construit en utilisant la méthodologie MSCI Global Investable Market Index (GIMI) pour satisfaire à des critères de taille, de liquidité et de capitalisation boursière ajustée du flottant.

L'indice couvre environ 85 % de l'ensemble des opportunités d'investissement en actions à l'échelle mondiale.

La méthodologie MSCI et sa méthode de calcul impliquent un nombre variable de sociétés constituant l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'Indice.

La performance suivie est celle des cours de clôture de l'Indice en US Dollars.

La composition de l'Indice est rééquilibrée chaque trimestre.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant s'exposer aux marchés actions développés et émergents.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE

SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque lié à l'investissement dans les pays émergents et en voie de développement, Risque de perte en capital, risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ou une quelconque filiale de MSCI, ou l'une quelconque des entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI et les indices MSCI sont des marques de MSCI ou de ses filiales et ont fait l'objet d'une licence accordée, pour certains besoins, à Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement ou le calcul des indices MSCI, ne fait aucune déclaration et n'émet aucune de garantie, expresse ou implicite, vis-à-vis des détenteurs d'actions du compartiment ou plus généralement du public, quant à l'opportunité d'une transaction sur des actions du compartiment en général, ou les actions du compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à répliquer la performance du marché actions international. MSCI et ses filiales

sont détenteurs de certains noms, marques déposées et des indices MSCI qui sont déterminés, composés et calculés par MSCI sans concertation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI, n'est tenu de prendre en considération les besoins de Amundi Asset Management ou des détenteurs d'actions du compartiment pour déterminer, composer ou calculer les indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI ne prend aucune décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité des actions du compartiment, ou encore la détermination et le calcul de la formule permettant d'établir la valeur liquidative du Fonds. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI, n'endosse aucune responsabilité ni obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

BIEN QUE MSCI SE PROCURE LES DONNÉES INCORPORÉES DANS LES INDICES OU UTILISÉES POUR CALCULER CES DERNIERS AUPRÈS DE SOURCES DONT MSCI CROIT QU'ELLES SONT DIGNES DE FOI, NI MSCI NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE PARTICIPANT À LA CRÉATION OU AU CALCUL D'INDICES MSCI NE GARANTIT L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉS. NI MSCI NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE DANS LA CRÉATION D'UN CALCUL DES INDICES MSCI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QU'OBTIENDRA LE DÉTENTEUR D'UNE LICENCE MSCI, LES CLIENTS DUDIT LICENCIE AINSI QUE LES CONTREPARTIES, LES PORTEURS D' ACTIONS DU COMPARTIMENT OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, DE L'UTILISATION DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE INCLUSE EN RELATION AVEC LES DROITS DONNÉS EN LICENCE OU POUR TOUTE AUTRE UTILISATION. NI MSCI NI AUCUNE AUTRE PARTIE NE DONNE DE GARANTIES EXPRESSES OU IMPLICITES ET MSCI REJETTE TOUTES GARANTIES SUR LA VALEUR COMMERCIALE OU SUR L'ADÉQUATION POUR UNE UTILISATION SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES INCLUSES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS LA RESPONSABILITÉ DE MSCI OU DE TOUTE AUTRE PARTIE NE SERA ENGAGÉE POUR DE QUELCONQUES DOMMAGES QUE CEUX-CI SOIENT DIRECTS, INDIRECTS OU AUTRE (Y COMPRIS LA PERTE DE RÉSULTATS) MÊME EN CAS DE CONNAISSANCE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 47

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Nasdaq-100 II

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement du **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Nasdaq-100 II** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution à la hausse comme à la baisse de l'indice NASDAQ-100 Notional Net Total Return index (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis (USD) et composé des 100 grandes sociétés non financières américaines et internationales, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Daily Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie quotidienne de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est composé de 100 des plus grandes sociétés non financières américaines et internationales cotées au NASDAQ en fonction de leur capitalisation boursière.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est composé de 100 valeurs et regroupe les plus grosses capitalisations des secteurs suivants : matériel et logiciels informatiques, télécommunications, commerce de détail/de gros et biotechnologie. Il exclut en revanche les entreprises du secteur financier, notamment les sociétés d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'Indice.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice.

La révision de l'Indice a lieu trimestriellement.

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction, ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet de son fournisseur à l'adresse :

https://indexes.nasdaqomx.com/docs/methodology_NDX.pdf et <https://indexes.nasdaqomx.com>.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice :

https://indexes.nasdaqomx.com/docs/methodology_NDX.pdf et <https://indexes.nasdaqomx.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES

OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR
TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.**ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT**

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant s'exposer aux marchés actions non-financiers des États-Unis et internationaux.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'Annexe C – Prise en compte des risques spécifiques et facteurs de risques, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une Classe, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le(s) produit(s) n'est/ne sont en aucune façon financé(s), recommandé(s), commercialisé(s) ou promu(s) par Nasdaq Stock Market, Inc ou ses filiales. (Nasdaq et ses filiales seront désignées les « Sociétés »). Les Sociétés ne garantissent pas la légalité, la pertinence, l'exactitude ou le caractère adéquat des descriptions et des déclarations relatives au(x) produit(s).

Les Sociétés ne donnent aucune garantie, expresse ou tacite, aux détenteurs du/des produit(s), ou à toute autre personne, quant au bien-fondé d'un investissement dans les titres ou, plus particulièrement, dans ce/ces produit(s), ou quant à la capacité de l'indice Nasdaq-100® à répliquer la performance globale du marché. Les

seuls liens entre les Sociétés et Amundi Asset Management (le titulaire de la licence) résultent de l'octroi de la licence portant sur les indices Nasdaq®, Nasdaq-100® et Nasdaq-100 Index® et sur certaines marques détenues par les Sociétés, ainsi que de l'utilisation de l'indice Nasdaq-100 Index®, qui est établi, composé et calculé par Nasdaq sans consulter le titulaire de la licence ni tenir compte du produit.

Nasdaq n'est nullement tenu de prendre en compte les besoins du titulaire de la licence ou du détenteur du produit pour déterminer, construire ou calculer l'indice Nasdaq-100 Index®.

Les Sociétés ne sont pas responsables et n'ont pas participé à la fixation de la date d'émission, du prix et de la quantité de produit(s) à émettre, non plus qu'à la détermination ou au calcul de l'équation régissant la conversion du produit en espèces. Les Sociétés déclinent toute responsabilité à l'égard de la gestion, du marketing ou de la négociation des produit(s).

Les Sociétés ne garantissent pas l'exactitude et/ou le calcul en continu du Nasdaq-100 Index® ou des titres qui le composent. Les Sociétés ne donnent aucune garantie, expresse ou tacite, quant aux résultats pouvant être obtenus par le titulaire de la licence, les propriétaires de produit ou toutes autres personnes ou entités utilisant le Nasdaq-100 Index®, ou tout autre titre entrant dans sa composition.

ANNEXE 48

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Stoxx Banks

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement du **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Stoxx Banks** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution à la hausse comme à la baisse de l'indice Euro STOXX Banks index (l'« **Indice** ») libellé en euros et représentatif de la performance des banques de la zone euro, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'indice mesure la performance des banques de la zone euro, telles que définies par l'Industry Classification Benchmark (ICB).

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré par la capitalisation boursière flottante.

Il offre une exposition aux pays de la zone euro tels que définis par la classification des pays Stoxx.

L'indice est un sous-indice de l'EURO STOXX (l'« **Indice parent** »), qui mesure la performance des actions de grande, moyenne et petite capitalisations boursières des pays de la zone euro

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'Indice.

L'Indice est calculé quotidiennement au cours de clôture en utilisant les prix de clôture officiels des bourses de cotation des titres constituants.

La composition de l'Indice est rééquilibrée chaque trimestre aux mois de mars, juin, septembre et décembre.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations

sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.stoxx.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.stoxx.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du

Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA), ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant s'exposer au marché actions de la zone euro.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le Prospectus), les droits de rachat ne s'appliqueront pas, mais les Droits de sortie s'appliqueront et seront calculés sur la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'Actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque lié au prêt de titres, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations sont disponibles à la section du Prospectus intitulée « PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ ».

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX et ses Concedants de licence n'ont pas d'autre lien avec le détenteur de licence que la

licence qui a été attribuée pour l'indice EURO STOXX® Banks Index et les marques déposées associées à des fins d'utilisation en rapport avec le Compartiment.

STOXX et ses concédants :

- ne font aucune déclaration de garantie quant à l'opportunité d'une transaction sur les parts ou unités du Compartiment, qu'ils s'abstiennent également de vendre et de promouvoir ;
- ne fournissent aucune recommandation d'investissement à quiconque en ce qui concerne le Compartiment ou à quelque autre titre que ce soit ;
- ne peuvent être tenus pour responsables ni débiteurs d'une quelconque obligation au titre de l'émission, du nombre ou du prix des actions du Compartiment, et ne prendront aucune décision à cet égard ;
- ne peuvent être tenus pour responsables ni débiteurs d'une quelconque obligation au titre de l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.
- ne sont pas tenus de prendre en considération les besoins du Compartiment ou de ses détenteurs d'actions pour déterminer, composer ou calculer l'indice EURO STOXX® Banks Index.

STOXX et ses Concédants de licence déclinent toute responsabilité, quelle qu'elle soit, au titre du Compartiment. STOXX et ses concédants n'accordent aucune garantie de quelque sorte que ce soit, expresse ou implicite, concernant :

- les résultats devant être obtenus par le Compartiment, le détenteur d'actions du Compartiment ou toute personne impliquée dans l'utilisation de l'indice Compartiment et des données incluses dans EURO STOXX® Banks Index ;
- l'exactitude ou l'exhaustivité de l'indice EURO STOXX® Banks Index et des données qu'il contient ;
- la négociabilité de l'indice EURO STOXX® Banks Index et de ses données ainsi que leur adéquation à un usage précis ou à une fin particulière.

STOXX et ses Concédants de licence ne peuvent être tenus pour responsables de quelque erreur, omission ou interruption que ce soit dans l'indice EURO STOXX® Banks Index ou les données qu'il contient.

En aucun cas STOXX ne sera tenu pour responsable d'une perte économique, quelle

qu'elle soit, y compris toute perte indirecte, même si STOXX a connaissance d'un tel risque.

Le contrat de licence entre LIAM et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des actionnaires ou des détenteurs de parts du Compartiment ou de tiers.

ANNEXE 49

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition** (le « **Compartiment** ») est de reproduire l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du Bloomberg MSCI Euro Corporate Paris Aligned Green Tilted Index (l'« **Indice** ») libellé en euros et représentatif de la performance du compartiment du marché des obligations d'entreprise de qualité « investment grade » libellées en euros, qui vise à respecter et à excéder les normes minimales des EU Paris-aligned Benchmarks (les « **EU PAB** ») requises en vertu d'actes délégués complétant le Règlement (UE) 2019/2089 modifiant le Règlement (UE) 2016/1011 (le « **Règlement sur les indices de référence** »), tout en réduisant au minimum la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions couvertes mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

• **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est construit à partir de l'Indice Bloomberg Euro Corporate Index (l'« **Indice parent** ») et vise à être représentatif du marché des obligations d'entreprise de qualité « investment grade » libellées en euros tout en respectant et dépassant les normes minimales du compartiment du label EU PAB, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications liées aux Informations ESG du présent Prospectus. L'indice utilise une approche d'optimisation qui

vise à minimiser le risque total actif par rapport à l'Indice parent sous contraintes.

• **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice obligataire calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays.

La pondération de chaque composante est calculée sur la base de la valeur de marché de l'obligation en question. Les obligations sont évaluées en fonction du cours acheteur du marché. Le prix initial des nouvelles émissions obligataires privées incluses dans l'Indice est le prix d'offre.

Il s'agit d'un indice de rendement total. Un indice de rendement total mesure la performance des composantes de l'indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice.

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.bloomberg.com/indices.

La composition de l'Indice est révisée et repondérée tous les mois.

La fréquence des rééquilibrages telle que décrite ci-dessus aura une incidence sur les coûts au cours de la réalisation de l'objectif d'investissement. Les frais particuliers générés par ces rééquilibrages de l'Indice incluent les coûts de transaction supplémentaires.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice.

• **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet www.bloomberg.com/indices

Pour de plus amples informations concernant l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par des compartiments indiciels » de la Section I « Objectifs d'investissement / Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements », qui figure dans la partie principale du présent Prospectus, ainsi qu'à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT SUR LES INDICES DE RÉFÉRENCE.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

• Objectif d'investissement

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant s'exposer à la performance, positive ou négative, du marché

des obligations de pays non-émergents libellées en euros. Il vise à représenter la performance d'une stratégie d'investissement conçue pour dépasser les normes minimales des PAB de l'UE en vertu du Règlement Benchmark et intègre un large éventail d'objectifs liés au climat.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,80 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque lié à une faible diversification, Risque d'érosion du capital, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque spécifique dû aux notations de crédit par différentes agences, Risque que l'Objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la catégorie, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul des notes ESG, Risque de calcul de l'indice.

En outre, le Compartiment est exposé au risque suivant :

Risque de consolidation illimitée sur la différence entre les pondérations des composantes de l'Indice parent

La fonction objective de l'optimisation est de minimiser le Risque Total Actif entre l'Indice et l'Indice parent. Cependant, pour toute stratégie alignée sur le scénario 1,5 °C, il existe un objectif absolu de décarbonation qui doit être atteint pour respecter cet alignement. Étant donné que le niveau de réduction des émissions requis pour un scénario à 1,5 °C est absolu (comme indiqué par le TEG (le Groupe technique d'experts de l'UE sur la finance durable, 2019)), l'Indice est conçu pour décarboner d'une année sur l'autre. La réduction relative de l'empreinte carbone nécessaire, à tout moment, pour atteindre cet objectif dépendra donc de la décarbonation de l'Indice parent. La réduction de l'empreinte carbone requise serait amplifiée par un manque de décarbonation (ou une empreinte carbone accrue) dans l'Indice parent. Un tel scénario peut nécessiter un niveau croissant de différence de pondération des composantes par rapport à l'Indice parent au fil du temps pour atteindre l'objectif souhaité. Par conséquent, si une telle situation devenait particulièrement extrême, il se pourrait que l'écart de suivi historique, vérifié a posteriori, ne donne pas une indication parfaite de l'écart de suivi réalisé à une date future. Par conséquent, l'écart de suivi futur entre l'Indice et l'Indice parent ne peut jamais être complètement plafonné.

Risque de retrait du label EU PAB

L'Indice a été conçu pour être éligible au label « Indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris » (« EU PAB »).

Par conséquent, il devrait recevoir le label européen EU PAB associé. Pour que l'Indice satisfasse à la réglementation, l'Indice doit, entre autres contraintes, réduire son intensité carbone à 7 % d'une année sur l'autre, en utilisant des pondérations moyennes tout au long de la période. L'Indice est conçu pour être conforme à chaque rééquilibrage. Cependant, les pondérations des sociétés, leurs émissions de carbone et leur valeur d'entreprise (qui est le dénominateur dans le calcul de l'intensité carbone) peuvent changer entre les rééquilibrages. Pour éviter toute ambiguïté, la réglementation garantit que le rapport d'indice est basé sur les pondérations moyennes entre les rééquilibrages. Par conséquent, même si l'Indice est conforme à chaque rééquilibrage, il peut ne pas nécessairement conserver le label sur la base de rapports utilisant des pondérations moyennes. En outre, dans une situation où un trop grand nombre de sociétés de l'Indice parent augmentent leurs émissions absolues de carbone sur une longue période, l'Indice pourrait ne pas respecter certaines normes minimales des indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris et ainsi perdre son label.

Risque d'optimisations insolubles

La méthodologie de l'Indice utilise une méthodologie d'optimisation. En cas d'optimisation, il n'est pas toujours possible de trouver une solution qui réponde simultanément à toutes les contraintes. Il est prudent de garder à l'esprit que les augmentations de futures réductions relatives de l'empreinte carbone, ou les changements imprévisibles dans les exclusions ou d'autres ensembles de données, peuvent éventuellement provoquer des optimisations insolubles à l'avenir. Pour cette raison, une hiérarchie d'assouplissement des contraintes a été établie dans la méthodologie de l'Indice afin de minimiser davantage le risque de solutions insolubles.

Risque lié aux données carbone utilisées dans la méthodologie de l'Indice

L'analyse des émissions de gaz à effet de serre actuelles et futures des entreprises est en partie fondée sur des données déclaratives, des modèles et des estimations. En l'état actuel des données disponibles, toutes les données en matière d'émission de gaz à effet de serre ne sont pas disponibles et certaines sont fondées sur un modèle (notamment celles relatives au périmètre « scope 3 » qui inclut toutes les émissions de gaz à effet de serre qui ne sont pas directement liées à la fabrication d'un produit).

Risque lié aux composantes de l'Indice

La méthodologie de l'Indice n'empêche pas l'intégration de titres de sociétés émettrices de gaz à effet de serre.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Dans la gestion des Risques en matière de durabilité du Compartiment, la Société de gestion s'en remet à Bloomberg Barclays en sa qualité

d'administrateur de l'Indice, dont la Méthodologie de notation ESG identifie et intègre les Risques en matière de durabilité pertinents et importants. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment.

Pour plus d'informations sur la méthodologie de notation MSCI ESG et l'Indice, veuillez vous référer à : www.bloomberg.com/.

Indices. De plus amples informations sont disponibles dans la section « DIVULGATIONS RELATIVES AUX QUESTIONS DE DURABILITÉ » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (conjointement « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 50

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi EUR Corporate Bond ex-Financials ESG

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi EUR Corporate Bond ex-Financials ESG** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid ex Financial SRI Sustainable (l'« **Indice** ») libellé en euros (EUR), qui est représentatif de la performance du marché des obligations d'entreprises non financières de catégorie investment grade libellées en euros, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment aura également recours à une stratégie de couverture de change mensuelle, afin de réduire l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice propose une exposition au marché des obligations de catégorie investment grade libellées en euros de sociétés émettrices d'autres secteurs que celui des services financiers, respectant les exigences ESG décrites plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice obligataire calculé, maintenu et publié par Bloomberg Barclays Indices.

La pondération de chaque composante est calculée sur la base de la valeur de marché de l'obligation en question. Les obligations sont

évaluées en fonction du cours acheteur du marché. Le prix initial des nouvelles émissions obligataires privées incluses dans l'Indice est le prix d'offre.

Il s'agit d'un indice de rendement total. Un indice de rendement total mesure la performance des composantes de l'indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice.

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction, ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet de son fournisseur à l'adresse :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

La composition de l'Indice est révisée et repondérée tous les mois.

La fréquence des rééquilibrages telle que décrite ci-dessus aura une incidence sur les coûts au cours de la réalisation de l'objectif d'investissement. Les frais particuliers générés par ces rééquilibrages de l'Indice incluent les coûts de transaction supplémentaires.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché des obligations privées de la zone euro.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à

l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque spécifique lié à la notation du crédit par différentes agences, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque d'érosion du capital, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque lié à une faible diversification, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul des scores ESG, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Dans la gestion des Risques en matière de durabilité du Compartiment, la Société de gestion s'en remet à Bloomberg Barclays en sa qualité d'administrateur de l'Indice, dont la Méthodologie de notation ESG identifie et intègre les Risques en matière de durabilité pertinents et importants. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG de MSCI et de l'Indice, veuillez consulter : www.msci.com/bloomberg-barclays-msci-esg-fixed-income-indexes. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc (collectivement avec ses sociétés affiliées, « Barclays »), utilisées sous licence. Bloomberg ou les concédants de licence de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les Indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas affiliés à Amundi Asset Management et n'approuvent, n'avalisent, n'examinent ou ne recommandent pas le Compartiment. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci. .

ANNEXE 51

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture** (l'« **Indice** ») consiste à reproduire l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du Bloomberg Energy & Metals Equal-Weighted Total Return Index (l'« **Indice** »), libellé en dollars américains et converti en euros, représentatif du marché des matières premières et, plus particulièrement, des métaux de base et des métaux précieux, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Erreur de suivi** »).

Pour les catégories d'actions couvertes mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

• **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif du marché des matières premières du compartiment et plus particulièrement des marchés de l'énergie, des métaux de base et des métaux précieux, à l'exclusion des produits agricoles.

Il suit l'évolution des prix des contrats future sur l'énergie, les métaux de base et les métaux précieux.

• **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice reflète la performance d'un panier pondéré à parts égales de 12 contrats à terme standardisés sur l'énergie et les matières premières (métaux de base et précieux). L'Indice reflète l'évolution du cours des contrats à terme du compartiment sur ces matières premières.

Ces contrats à terme sont cotés en bourse aux États-Unis (CME), en Europe (ICE Europe) et au Royaume-Uni (LME).

Un mécanisme mensuel d'achat/vente (« **Renouvellement** ») permet de changer les contrats figurant dans l'Indice.

Bourse	Matière première	Pondération des matières premières aux dates de renouvellement
CME	Gaz naturel (HH)	1/12
CME	Pétrole brut (WTI)	1/12
ICE Europe	Pétrole brut Brent	1/12
ICE Europe	Gasoil à faible teneur en soufre	1/12
LME	Aluminium	1/12
LME	cuivre	1/12
LME	Zinc	1/12
LME	Nickel	1/12
CME	Platiniium	1/12
CME	Palladium	1/12
CME	Argent	1/12
CME	Or	1/12

À chaque renouvellement, le poids de chaque composante est également réajusté de façon à conserver une exposition uniforme et préserver le niveau de diversification requis.

L'Indice est un indice de type « Total Return » (c'est-à-dire que tous les coupons détachés par les composantes de l'Indice sont réinvestis dans ce dernier)

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice.

L'Indice est rééquilibré trimestriellement à la clôture du dernier Jour ouvré des mois de janvier, avril, juillet et octobre.

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet : <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-commodity-index-family/>.

La fréquence des rééquilibrages telle que décrite ci-dessus aura une incidence sur les coûts au cours de la réalisation de l'objectif d'investissement.

• **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'indice :

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-commodity-index-family/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels à la recherche d'une exposition aux matières premières, et plus précisément aux marchés de matières premières, de l'énergie, des métaux de base et des métaux précieux.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par action sera disponible au siège de la Société et publiée sur le site www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux matières premières, Risques liés aux contrats à terme standardisés composant l'indice/la stratégie, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment.

De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

« BLOOMBERG® est une marque commerciale et une marque de service de BLOOMBERG Finance L.P. BLOOMBERG Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (collectivement, « BLOOMBERG »), y compris BLOOMBERG Index Services Limited, l'administrateur de l'Indice (« BISL »), ou les concédants de licence de BLOOMBERG détiennent tous les droits de propriété de l'Indice.

Bloomberg n'est ni l'émetteur ni le producteur du Compartiment et n'a aucune responsabilité, obligation ou devoir envers les investisseurs du Compartiment. L'Indice est autorisé à être utilisé par la Société de Gestion en tant qu'Émetteur du Compartiment. Le seul lien entre Bloomberg et l'Émetteur du Compartiment en ce qui concerne l'Indice est l'octroi d'une licence au Compartiment, qui est défini, composé et calculé par BISL, ou tout successeur de ce dernier, indépendamment de l'Émetteur du Compartiment ou des détenteurs du Compartiment.

Les investisseurs acquièrent le Compartiment auprès de la Société de Gestion et n'acquièrent aucune participation dans l'Indice et n'établissent aucun lien de quelque nature que ce soit avec Bloomberg lors d'un investissement dans le Compartiment. Le Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Bloomberg. Bloomberg s'abstient de toute déclaration et ne donne aucune garantie, expresse ou tacite, quant à l'opportunité d'investir dans le Compartiment ou l'opportunité d'investir dans des valeurs mobilières en général ou la capacité du Compartiment à reproduire la

performance du marché correspondante ou relative. Bloomberg n'a pas émis d'avis sur la légalité ou le caractère adéquat du Compartiment à une personne physique ou morale. Bloomberg ne peut être tenu pour responsable de, et n'a pas participé à, la fixation de la date d'émission, des prix ou des quantités d'actions à émettre du Compartiment. Bloomberg n'est pas tenu de prendre en considération les besoins de l'Émetteur du Compartiment ou des détenteurs du Compartiment ou de toute autre tierce partie aux fins d'élaborer, de composer ou de calculer l'Indice. Bloomberg n'a aucune obligation ni responsabilité quant à l'administration, la commercialisation ou la négociation du Compartiment.

L'accord de licence conclu entre Bloomberg et la Société de Gestion est uniquement destiné au bénéfice de Bloomberg et de la Société de Gestion et non au bénéfice des détenteurs du Compartiment, des investisseurs ou d'autres tierces parties.

BLOOMBERG NE PEUT ÊTRE TENU RESPONSABLE ENVERS L'ÉMETTEUR, LES INVESTISSEURS OU D'AUTRES TIERS DE LA QUALITÉ, DE L'EXACTITUDE ET/OU DE L'EXHAUSTIVITÉ DE L'INDICE OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCLUSES OU DES INTERRUPTIONS DANS LA MISE À DISPOSITION DE L'INDICE. BLOOMBERG NE DONNE AUCUNE GARANTIE, EXPRESSE OU TACITE, À L'ÉMETTEUR, AUX INVESTISSEURS OU À UNE QUELCONQUE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE, QUANT AUX RÉSULTATS QU'ILS RETIRERONT DE L'UTILISATION DE L'INDICE OU DE QUELCONQUES DONNÉES INCORPORÉES DANS CELUI-CI. BLOOMBERG NE DONNE AUCUNE GARANTIE, EXPRESSE OU TACITE, ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE QUANT À LA QUALITÉ MARCHANDE OU L'ADÉQUATION À UN USAGE DONNÉ OU UNE FINALITÉ PARTICULIÈRE DE L'INDICE OU DE QUELCONQUES DONNÉES INCORPORÉES DANS CELUI-CI. BLOOMBERG SE RÉSERVE LE DROIT DE MODIFIER LES MÉTHODES DE CALCUL OU DE PUBLICATION, OU DE CESSER LE CALCUL OU LA PUBLICATION DE L'INDICE, ET BLOOMBERG NE SAURAIT ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE DE TOUT CALCUL INCORRECT OU DE TOUTE PUBLICATION INCORRECTE, RETARDÉE OU INTERROMPUE CONCERNANT L'INDICE. BLOOMBERG NE SAURAIT ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE DE TOUT DOMMAGE, Y COMPRIS, MAIS SANS S'Y LIMITER, TOUT DOMMAGE PARTICULIER, INDIRECT OU CONSÉCUTIF, OU TOUTE PERTE DE BÉNÉFICE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES, RÉSULTANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE OU DE TOUTE DONNÉE Y FIGURANT OU CONCERNANT LE COMPARTIMENT.

ANNEXE 52

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y** (le « **Compartiment** ») est de refléter la performance de l'indice FTSE MTS Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y (Mid Price) (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, qui est représentatif de la performance des obligations d'État de la zone euro dont l'échéance résiduelle se situe entre 1 et 3 ans, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence offre une exposition à la performance des obligations d'État de la zone euro dont l'échéance se situe entre 1 et 3 ans, et plus particulièrement celles des pays de la zone euro ayant reçu la notation « AAA » ou équivalent d'au moins deux des trois agences de notation principales.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est composé de titres obligataires émis par certains États membres de la zone euro bénéficiant de la notation la plus élevée, dont le poids est déterminé en fonction d'indicateurs macroéconomiques. L'Indice de référence doit comprendre au minimum cinq pays émetteurs.

Les composantes de l'Indice de référence sont sélectionnées selon les mêmes critères que ceux utilisés pour les autres indices FTSE MTS Eurozone Government Broad (sauf en ce qui concerne le critère de la notation de crédit) décrits ci-après.

Pour être incluses dans l'Indice de référence, les obligations doivent satisfaire aux critères suivants :

- (i) nominal et coupons libellés en euros, n'incluant ni option ni convertibilité, et avec une échéance entre 1 et 3 ans ;
- (ii) être émises par certains gouvernements souverains de la zone euro et sélectionnées par FTSE MTS parmi une liste de pays ayant reçu la notation « AAA » par au moins deux des agences de notation principales (Standard & Poor's, Moody's et Fitch) ;
- (iii) être cotées sur la plateforme FTSE MTS ;
- (iv) un encours minimum de 2 milliards d'euros.

La composition de l'Indice de référence est révisée et repondérée tous les mois.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice de référence à 17 h 15 (CET – heure de l'Europe centrale).

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total mesure la performance des composantes de l'indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive à l'adresse : <http://www.ftse.com/products/indices/ftsemts>

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations supplémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <http://www.ftse.com/products/indices/ftsemts>

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux obligations émises par les États membres de la zone euro ayant reçu la notation « AAA » ou équivalent par au moins deux des agences de notation S&P, Moody's et Fitch.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,05 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risque lié au prêt de titres, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par FTSE TMX Global Debt Capital Markets (collectivement désignés comme les « **Détenteurs** »).

FTSE TMX Global Debt Capital Markets ne peut être tenu responsable de la promotion ou du marketing du Compartiment.

FTSE MTS et les noms des indices FTSE MTS (FTSE MTS Index™) et les indices FTSE MTS indices (FTSE MTS Indices™) sont des marques de FTSE TMX Global Debt Capital Markets. Les indices FTSE MTS sont calculés par FTSE TMX Global Debt Capital Markets et sont commercialisés et distribués par MTSNext, une société filiale de FTSE TMX Global Debt Capital Markets.

Ni FTSE TMX Global Debt Capital Markets, ni MTSNext ne sauraient être tenus pour responsables de toute perte ou dommage, de quelque nature que ce soit (y compris, notamment, les pertes d'investissement) liés en tout ou en partie au Compartiment ou à la fourniture de l'Indice de référence, de sous-indices ou de marques déposées.

ANNEXE 53

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y** (le « **Compartiment** ») est de refléter la performance de l'indice FTSE MTS Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y (Mid Price) (l'« **Indice de référence** ») libellé en euros, qui est représentatif de la performance des obligations d'État de la zone euro dont l'échéance résiduelle se situe entre 5 et 3 ans, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,10 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

• Objectifs de l'Indice de référence

L'Indice de référence offre une exposition à la performance des obligations d'État dont l'échéance résiduelle se situe entre 3 et 5 ans, et plus particulièrement des pays de la zone euro, ayant reçu la notation « AAA » ou équivalent par au moins deux des agences de notation principales.

• Méthodologie de l'Indice de référence

L'Indice de référence est composé de titres obligataires émis par certains États membres de la zone euro bénéficiant de la notation la plus élevée, dont le poids est déterminé en fonction d'indicateurs macroéconomiques. L'Indice de référence doit comprendre au minimum cinq pays émetteurs.

Les composantes de l'Indice de référence sont sélectionnées selon les mêmes critères que ceux utilisés pour les autres indices FTSE MTS Eurozone Government Broad (sauf en ce qui concerne le critère de la notation de crédit) décrits ci-après.

Pour être incluses dans l'Indice de référence, les obligations doivent satisfaire aux critères suivants :

- (j) nominal et coupons libellés en euros, n'incluant ni option ni convertibilité, et avec une échéance entre 3 et 5 ans ;

(ii) être émises par certains gouvernements souverains de la zone euro et sélectionnées par FTSE MTS parmi une liste de pays ayant reçu la notation « AAA » par au moins deux des agences de notation principales (Standard & Poor's, Moody's et Fitch) ;

(iii) être cotées sur la plateforme FTSE MTS ;

(iv) un encours minimum de 2 milliards d'euros.

La composition de l'Indice de référence est révisée et repondérée tous les mois.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice de référence à 17 h 15 (CET – heure de l'Europe centrale).

L'Indice de référence est un indice de type « Total Return » (rendement total). Un indice de rendement total mesure la performance des composantes de l'indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive à l'adresse : <http://www.ftse.com/products/indices/ftsemts>

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

• Informations supplémentaires sur l'Indice de référence

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <http://www.ftse.com/products/indices/ftsemts>

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

Le Compartiment a l'intention de recourir occasionnellement à des opérations de prêt de titres pour un ou plusieurs des objectifs spécifiques suivants : (i) la réduction des risques ; (ii) la réduction des coûts ; ou (iii) la génération d'un capital ou d'un revenu supplémentaire pour l'OPCVM, avec un niveau de risque conforme au profil de risque de l'OPCVM et aux règles de diversification des risques énoncées à l'Article 52 de la Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux obligations émises par les États membres de la zone euro ayant reçu la notation « AAA » ou équivalent par au moins deux des agences de notation S&P, Moody's et Fitch.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,05 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risque lié au prêt de titres, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se

trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section du présent Prospectus intitulée Politique de distribution.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par FTSE TMX Global Debt Capital Markets (collectivement désignés comme les « **Détenteurs** »).

FTSE TMX Global Debt Capital Markets ne peut être tenu responsable de la promotion ou du marketing du Compartiment.

FTSE MTS et les noms des indices FTSE MTS (FTSE MTS IndexTM) et les indices FTSE MTS indices (FTSE MTS IndicesTM) sont des marques de FTSE TMX Global Debt Capital Markets. Les indices FTSE MTS sont calculés par FTSE TMX Global Debt Capital Markets et sont commercialisés et distribués par MTSNext, une société filiale de FTSE TMX Global Debt Capital Markets.

Ni FTSE TMX Global Debt Capital Markets, ni MTSNext ne sauraient être tenus pour responsables de toute perte ou dommage, de quelque nature que ce soit (y compris, notamment, les pertes d'investissement) liés en tout ou en partie au Compartiment ou à la fourniture de l'Indice de référence, de sous-indices ou de marques déposées.

ANNEXE 54

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI China

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI China** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI China Net Total Return USD (l'« **Indice** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), représentatif de l'économie chinoise via une exposition à des sociétés de grande et moyenne capitalisation, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

Dans la présente Annexe, le terme « Chine continentale » désigne la République populaire de Chine (« RPC »), à l'exclusion des régions administratives spéciales de Hong Kong et de Macao.

L'Indice offre une exposition au segment des moyennes et grandes capitalisations de l'Univers Chine tel que défini dans la méthodologie de construction des indices MSCI Global Investable Market.

Les composants de l'Indice sont accessibles aux investisseurs non nationaux de Chine continentale.

L'univers MSCI China comprend les sociétés constituées en Chine continentale. Par ailleurs, les sociétés non constituées en Chine continentale peuvent être éligibles à l'univers MSCI China si elles sont étroitement liées à la Chine continentale, par exemple par la répartition géographique de leurs activités (en termes d'actifs et de revenus) ou la répartition géographique de leurs actionnaires.

En mars 2018, l'Indice comprenait principalement des actions cotées à Hong Kong et aux États-Unis.

À partir de juin 2018, les actions A de forte capitalisation (sociétés constituées en Chine continentale et cotées aux Bourses de Shanghai ou de Shenzhen en renminbi [RMB]) seront partiellement incluses dans l'Indice. En septembre 2018, une fois cette inclusion partielle terminée, le poids des actions A dans l'Indice sera marginal. Les actions A éligibles à cette inclusion partielle sont celles qui sont accessibles aux investisseurs non nationaux de la Chine continentale par le biais d'échanges entre les marchés chinois de Shanghai et Shenzhen et la bourse de Hong Kong (Shanghai-Shenzhen Stock Connect ou Shenzhen-Hong Kong Stock Connect).

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

L'Indice est un indice pondéré par la capitalisation boursière flottante. Le processus d'ajustement de la capitalisation boursière est décrit dans la méthodologie de construction des indices MSCI Global Investable Market.

La performance suivie est basée sur les cours de clôture de l'Indice.

La méthode de construction de l'Indice est décrite en détail à l'adresse suivante : www.msci.com

L'Indice est calculé par MSCI.

La méthodologie MSCI et sa méthode de calcul entraînent un nombre variable de sociétés constituant l'Indice.

La composition de cet Indice est révisée et repondérée tous les trimestres (en février, mai, août et novembre).

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet : www.msci.com

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des valeurs composant l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution est réinvesti après déduction de toute retenue à la source applicable.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et

ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à la performance des grandes et moyennes capitalisations représentatives de l'économie chinoise.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories

d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur <http://www.amundiETF.com>.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risques liés à l'investissement dans des valeurs de moyenne capitalisation, Risque lié à l'investissement dans les pays émergents et en voie de développement, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de

contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

Risque spécifique lié à l'investissement en République Populaire de Chine :

Les investisseurs du Compartiment doivent être conscients des risques ci-après, inhérents à un investissement en République Populaire de Chine (RPC) :

- Risques liés aux Programmes Stock Connect

Le Compartiment investira dans des actions A par le biais d'échanges entre les marchés chinois de Shanghai et Shenzhen et la bourse de Hong Kong (« les Programmes Stock Connect »). À la date de cette publication, les Programmes Stock Connect imposent un quota quotidien limitant la valeur totale nette des ordres d'achat pouvant être exécutés sur la Bourse chinoise.

Si ce quota quotidien est dépassé, les ordres d'achat par le biais des Programmes Stock Connect seront automatiquement suspendus (du moins temporairement), ce qui pourrait limiter la capacité du Compartiment à atteindre son objectif d'investissement.

- Risques économiques, politiques et sociaux

Investir en République Populaire de Chine peut impliquer certains risques qui ne sont en général pas associés aux investissements dans des économies ou des marchés plus développés, qui sont liés à une plus grande incertitude économique, politique et sociale.

En effet, le gouvernement chinois possède une très grande capacité de contrôle sur l'économie et tout changement politique imprévu, toute instabilité ou insécurité sociale et/ou toute évolution néfaste d'ordre diplomatique, politique, économique ou sociale en RPC, ou dans un territoire lié à la RPC (collectivement dénommés le « Changement politique »), pourraient entraîner des mesures et des restrictions supplémentaires susceptibles d'avoir des conséquences importantes et soudaines, telle une expropriation, une fiscalité confiscatoire ou une nationalisation de sociétés comprises dans le Compartiment. Tout Changement politique pourrait avoir des effets néfastes sur l'économie et les bourses de la RPC et, par conséquent, sur la valeur des investissements du Compartiment et pourrait entraîner la dissolution du Compartiment sur décision du Conseil d'administration.

- Risques économiques en RPC

L'économie de la RPC s'est développée très rapidement. Il n'est toutefois pas certain que cette croissance se poursuivra et celle-ci peut être inégale d'un secteur à l'autre de l'économie chinoise. Le gouvernement de la PRC a déjà mis

en place des mesures pour prévenir les accélérations trop fortes de la conjoncture et la transition d'une économie socialiste à une économie de marché du pays a entraîné des tensions sociales qui pourraient aller à l'encontre de cette transition ou compromettre son succès. L'un quelconque des risques ci-après pourrait diminuer la performance du Compartiment.

- Risque lié au système juridique de la RPC

Le système juridique de la RPC se fonde sur des textes législatifs. Néanmoins, certaines réglementations n'ont pas encore été mises en œuvre et rien ne garantit leur implémentation effective et totale dans le temps. Les règlements de la RPC en matière de lutte contre l'instabilité des taux de change sont notamment relativement récents et leur application est encore relativement incertaine. En outre, ces règlements laissent aux autorités chinoises, et notamment à la China Securities Regulatory Commission (CSRC) et au State Administration of Foreign Exchange (SAFE), une grande liberté dans leur interprétation respective de ces règlements, ce qui donne lieu à des incertitudes quant à la manière dont ils pourraient être appliqués et utilisés. Toutes ces considérations peuvent avoir des répercussions négatives sur les performances du Compartiment.

- Normes de comptabilité et d'audit

Les normes et les pratiques en matière de comptabilité, de vérification et d'information financière applicables aux sociétés en RPC peuvent différer de celles des pays aux marchés financiers plus développés. Ces différences peuvent concerner des domaines tels que les différentes méthodes d'évaluation des propriétés et des actifs, et les exigences en matière de divulgation d'informations aux investisseurs. Les informations disponibles sur les sociétés de RPC peuvent donc ne pas être aussi complètes, exactes et à jour que les informations disponibles sur des sociétés cotées sur des marchés plus développés.

- Risque de suspension de cotation

Les titres composant l'Indice peuvent faire l'objet de suspension temporaire de cotation, entraînant l'incapacité pour le Compartiment à les valoriser correctement et/ou à procéder à des opérations d'achats ou de ventes de ces titres

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se

trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la

création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 55

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Inverse Inflation Expectations 10Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Inverse Inflation Expectations 10Y** est de refléter la performance de l'indice iBoxx USD Inverse Breakeven 10-Year Inflation (l'« **Indice de référence** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), afin de procurer une exposition à une position courte sur des titres à 10 ans du Trésor américain protégés contre l'inflation (TIPS) et à une position longue sur des bons du Trésor américain présentant des durations équivalentes.

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est représentatif de la performance d'une position courte sur les 6 dernières émissions des titres à 10 ans du Trésor américain protégés contre l'inflation (les « **TIPS** ») et d'une position longue sur des bons du Trésor américain présentant des durations équivalentes, aucune émission ne représentant plus de 30 % de la position à chaque date de rééquilibrage.

L'écart de rendement (ou « **spread** ») entre les obligations nominales et les titres liés à l'inflation est communément désigné sous le terme « **point mort d'inflation** » (« **PMI** ») et est considéré comme une mesure des anticipations d'inflation du marché sur une période déterminée.

L'écart de rendement entre les titres liés à l'inflation et les obligations nominales est égal à l'opposé du PMI ; il n'a pas d'intérêt économique et peut être désigné par le « **PMI inverse** ».

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est conçu de façon à permettre une exposition inverse aux

changements dans les anticipations d'inflation intégrées par le marché en prenant :

- une position courte sur les 6 dernières émissions des TIPS à 10 ans ;
- une position longue sur les bons du Trésor américain présentant des durations équivalentes.

Les TIPS américains à 10 ans sont indexés sur l'indice des prix à la consommation aux États-Unis.

La combinaison de positions longues et courtes supprime les effets indésirables liés à la durée des titres à taux fixe, ce qui permet une exposition, principalement, mais de façon non limitative, aux variations inverses dans les anticipations d'inflation à 10 ans du marché.

La performance journalière de l'Indice de référence ne sera pas mesurée par la variation quotidienne inverse du PMI, ni par un multiplicateur de la variation quotidienne inverse du PMI, sinon par la performance quotidienne du panier long sur obligations nominales par rapport au panier de positions vendeuses liées à l'inflation, laquelle est théoriquement inversement corrélée à l'évolution de l'inflation attendue par le marché à l'échéance des obligations, représentée par le PMI à l'échéance considérée.

En théorie, une diminution de l'anticipation d'inflation à n ans entraîne une augmentation relative du prix de l'obligation nominale à n ans par rapport au prix de l'OII équivalente et, par conséquent, une augmentation de la performance d'une position acheteuse sur l'obligation nominale et d'une position vendeuse sur l'OII. L'Indice de référence étant composé d'une position vendeuse sur plusieurs OII et d'une position acheteuse sur plusieurs obligations nominales à échéances variées, sa performance ne sera pas liée exclusivement à l'anticipation inverse d'inflation à 10 ans, mais à la moyenne pondérée des anticipations d'inflation correspondant aux dates d'échéance des obligations comprises dans le panier. En outre, (i) les mouvements de prix découlant des divergences d'offre et de demande entre les OII et les obligations nominales correspondantes, (ii) les frais de transaction applicables aux composantes de l'Indice de référence et (iii) les cycles saisonniers et les éventuels portages négatifs dus à la saisonnalité (veuillez vous reporter au chapitre sur les facteurs de risque ci-après) donneront lieu à des écarts entre la performance de l'Indice de référence et les anticipations inverses d'inflation.

Il convient également de noter que l'Indice de référence ne permet pas de mesurer le taux d'inflation ou de désinflation réalisé et n'a pas non plus pour objectif de reproduire la performance d'un indice quelconque ni de mesurer le niveau réel des prix à la consommation. Toutefois, l'inflation réalisée affectera ponctuellement la performance de l'Indice de référence, en règle générale

lorsqu'elle diffère de l'anticipation du marché sur une période donnée.

La composition de l'Indice de référence est révisée et repondérée tous les mois.

L'Indice de référence est un indice de « rendement total » (les coupons détachés des composantes de l'indice sont réinvestis dans celui-ci).

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet :

<https://ihsmarkit.com/products/iboxx.html>.

- **Informations supplémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://ihsmarkit.com/products/iboxx.html>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition inverse aux changements dans les anticipations d'inflation au États-Unis.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque lié aux anticipations d'inflation, Risque spécifique lié aux effets de saisonnalité, de portage et de rétroactivité sur l'inflation, Risque de perte en capital, Risques liés au coût élevé d'un investissement dans une stratégie long/short et/ou à effet de levier, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

L'Indice de référence en question est la propriété de Markit Indices Limited (le « **Promoteur de l'Indice** ») et a été concédé sous licence au Compartiment.

Les parties conviennent que le Compartiment n'est ni agréé ni recommandé par le Promoteur de l'Indice.

En aucun cas le Commanditaire de l'Indice ne fournit de garantie – explicite ou implicite (y compris, mais sans s'y limiter, la valeur commerciale ou le caractère approprié pour toute

fin spécifique) – quant à l'Indice de référence ou à toute donnée incluse dans ou liée à l'Indice de référence et, en particulier, décline toute garantie quant à la qualité, l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice de référence ou des données incluses dans ou liées à l'Indice de référence, ou aux résultats obtenus à la suite de l'utilisation de l'Indice de référence et/ou de la composition de l'Indice de référence à une date ou un moment donnés, de même que la notation financière de toute entité émettrice ou tout événement de crédit ou similaire (quelle que soit la définition de cet événement) liée à une obligation dans l'Indice à une date donnée ou à tout autre moment.

Le Promoteur de l'Indice ne peut être tenu responsable pour quelque raison que ce soit d'une erreur dans l'Indice de référence et n'est pas tenu d'informer d'une telle erreur, dans le cas où elle surviendrait.

En aucun cas le Promoteur de l'Indice n'émet une recommandation d'achat ou de vente dans le Compartiment ni n'exprime d'opinion quant à la capacité de l'Indice de référence à reproduire la performance des marchés concernés, ou concernant l'Indice de référence ou toute opération ou produit y relatifs, ou sur les risques y afférents.

Le Promoteur de l'Indice n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins d'un tiers lorsqu'il compile, modifie, compose ou calcule l'Indice de référence. La responsabilité de l'acheteur ou d'un vendeur du Compartiment et du Promoteur de l'Indice ne peut pas être engagée dans le cas où le Promoteur de l'Indice ne prendrait pas les mesures nécessaires pour compiler, ajuster ou calculer l'Indice de référence.

Le Promoteur de l'Indice et ses sociétés affiliées se réservent le droit de traiter toute obligation qui compose l'Indice et peuvent, le cas échéant, accepter des dépôts, accorder des prêts ou effectuer toute autre activité de crédit, et plus généralement, exercer l'un ou la totalité des services financiers et de banque d'investissement ou toute autre activité commerciale auprès de ces émetteurs obligataires ou de leurs sociétés affiliées ; en outre, ils peuvent entreprendre ces activités comme si l'Indice n'existait pas, sans tenir compte de leurs éventuelles conséquences sur l'Indice de référence ou le Compartiment.

ANNEXE 56

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI China ESG Leaders Extra

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI China ESG Leaders Extra** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution à la hausse comme à la baisse de l'indice MSCI China Select ESG Rating and Trend Leaders Net Total Return Index (l'« **Indice** »), libellé en dollar des États-Unis (USD), afin de procurer une exposition à la performance des actions de grandes et moyennes capitalisation de l'ensemble de l'économie chinoise, émises par des entreprises bénéficiant de bonnes notations environnementales, sociales et de gouvernance (ESG), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance de l'économie chinoise par le biais d'une exposition à des sociétés à grande et moyenne capitalisation de l'univers MSCI China (tel que défini dans la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices) bénéficiant de bonnes notations environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) par rapport à leurs pairs du secteur et/ou dont les notations annuelles ESG se sont améliorées au cours de l'année. Les sociétés dont les produits ou activités ont des impacts sociaux ou environnementaux négatifs sont exclues de l'Indice, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

Dans la présente Annexe, le terme « Chine continentale » désigne la République populaire de Chine (« **RPC** »), à l'exclusion des régions administratives spéciales de Hong Kong et de Macao.

Les composants de l'Indice sont accessibles aux investisseurs non nationaux de Chine continentale. L'univers MSCI China comprend

les sociétés constituées en Chine continentale. Par ailleurs, les sociétés non constituées en Chine continentale peuvent être éligibles à l'univers MSCI China si elles sont étroitement liées à la Chine continentale, par exemple par la répartition géographique de leurs activités (en termes d'actifs et de revenus) ou la répartition géographique de leurs actionnaires.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI. La méthodologie MSCI et sa méthode de calcul entraînent un nombre variable de sociétés constituant l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage annuels. L'indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels afin de vérifier si les composants respectent toujours les critères d'exclusion.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

LE GESTIONNAIRE D'INVESTISSEMENT

La Société de Gestion a nommé Amundi Japan Ltd en tant que Gestionnaire d'investissement du Compartiment (le « **Gestionnaire d'investissement** ») en vertu de la Convention de délégation de gestion d'investissement (la « **Convention** »).

Amundi Japan Ltd est une société anonyme constituée au Japon dont le siège social est sis au 1-2-2 Uchisaiwaicho, Chiyoda-ku, Tokyo 100-0011.

En vertu de la présente Convention, le Gestionnaire d'investissement a accepté de mettre en œuvre l'objectif et la politique d'investissement décrits ci-dessus.

La Société de Gestion versera au Gestionnaire d'investissement une commission prélevée sur la Commission de gestion du Compartiment.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à la performance d'actions de grandes et moyennes capitalisations du marché chinois émises par des sociétés bénéficiant de bonnes notations environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) par rapport à leurs pairs du secteur et/ou dont les notations annuelles ESG se sont améliorées au cours de l'année.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque lié à l'investissement dans de petites et moyennes capitalisations, Risque lié aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque lié au manque de réactivité aux changements de circonstances, Risque lié à une faible diversification, Risque lié à l'investissement dans les pays émergents et en voie de développement, Risque en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque lié au calcul de l'Indice.

Risque spécifique lié à l'investissement en République Populaire de Chine :

Les personnes achetant des actions du Compartiment doivent être conscientes des risques suivants, qui sont inhérents aux investissements en Chine continentale :

- Risques liés aux Programmes Stock Connect

Le Compartiment négociera des actions A via le Shanghai Hong-Kong Stock Connect ou le Shenzhen Hong-Kong Stock Connect (les « **Programmes Stock Connect** »). À la date de cette publication, les Programmes Stock Connect imposent un quota quotidien limitant la valeur totale nette des ordres d'achat pouvant être exécutés sur la Bourse chinoise. Si ce quota quotidien est dépassé, les ordres d'achat par le biais des Programmes Stock Connect seront automatiquement suspendus (du moins temporairement), ce qui pourrait limiter la capacité du Compartiment à atteindre son objectif d'investissement.

- Risques économiques, politiques et sociaux

Investir en Chine continentale peut impliquer certains risques qui ne sont généralement pas associés aux investissements dans des économies ou des marchés plus développés et comporte en particulier des incertitudes économiques, politiques et sociales plus importantes.

En effet, le gouvernement chinois conserve un degré élevé de contrôle sur l'économie et tout changement politique inattendu, toute instabilité sociale, toute insécurité et/ou tout développement diplomatique, politique, économique ou social défavorable en Chine continentale ou en relation avec la Chine continentale (collectivement, un « **Changement politique** »), pourrait entraîner des actions et des restrictions supplémentaires ayant potentiellement des effets soudains et importants, tels que l'expropriation, la fiscalité confiscatoire ou la nationalisation des sociétés incluses dans le Compartiment. Tout changement politique pourrait avoir un impact négatif sur l'économie et les bourses de la Chine continentale et, par conséquent, sur la valeur des investissements du Compartiment, et pourrait en fin de compte entraîner la dissolution du Compartiment sur décision du Conseil d'administration.

- Risques économiques en Chine continentale

L'économie de la Chine continentale a enregistré une progression très rapide. Il n'est cependant pas certain que cette croissance se poursuive et il se peut qu'elle soit inégale entre les différents secteurs de l'économie en Chine continentale. De plus, le gouvernement de la Chine continentale a mis en œuvre de temps à autre différentes mesures visant à empêcher une accélération trop brutale du cycle économique. De plus, la transition d'une économie socialiste vers une économie davantage tournée vers le marché a entraîné des tensions économiques et sociales susceptibles de bloquer cette transition ou de compromettre sa réussite. Toutes ces considérations peuvent avoir des répercussions négatives sur les performances du Compartiment.

- Risque lié au système juridique de la Chine continentale

Le système juridique du pays repose sur le droit écrit. Néanmoins, certaines réglementations n'ont pas encore été mises en œuvre et rien ne garantit leur implémentation effective et totale dans le temps. En particulier, les réglementations de la Chine continentale sur le contrôle des taux de change sont assez récentes et leur application est encore très incertaine. En outre, ces règlements laissent aux autorités chinoises, et notamment à la China Securities Regulatory Commission (CSRC) et au State Administration of Foreign Exchange (SAFE), une grande liberté dans leur interprétation respective de ces règlements, ce qui donne lieu à des incertitudes quant à la manière dont ils pourraient être appliqués et utilisés. Toutes ces considérations peuvent avoir des répercussions négatives sur les performances du Compartiment.

- Normes de comptabilité et d'audit

Les normes et pratiques de comptabilité, d'audit et d'information financière applicables aux

entreprises de la Chine continentale peuvent différer de celles des pays dont les marchés financiers sont plus développés. Ces différences peuvent concerner des domaines tels que les différentes méthodes d'évaluation des propriétés et des actifs, et les exigences en matière de divulgation d'informations aux investisseurs. Par conséquent, les informations disponibles sur les sociétés de Chine continentale peuvent ne pas être aussi complètes, précises ou opportunes que les informations disponibles sur les sociétés cotées dans d'autres économies ou marchés plus développés.

- Risque de suspension de cotation

Les titres composant l'Indice peuvent faire l'objet de suspension temporaire de cotation, entraînant l'incapacité pour le Compartiment à les valoriser correctement et/ou à procéder à des opérations d'achats ou de ventes de ces titres

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Ce Compartiment est considérablement exposé aux régions qui peuvent avoir une surveillance gouvernementale ou réglementaire relativement faible ou une transparence ou une divulgation moindre des Facteurs de durabilité et peut donc être soumis à des Risques accrus en matière de durabilité.

Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG de MSCI, veuillez consulter : <http://www.msci.com>.

De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section du présent Prospectus intitulée Politique de distribution.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales dont Amundi Asset Management a acquis la licence à des fins spécifiques. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI,

ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Fonds. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Fonds lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Fonds ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Fonds. MSCI, les filiales de MSCI et les entités participant à la production des indices MSCI déclinent toute responsabilité et n'assument aucune obligation quant à l'administration, la gestion ou la commercialisation du Fonds.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 57

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI AC Asia Ex Japan

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI AC Asia Ex Japan** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI AC Asia Ex Japan Net Total ReturnTM (l'« **Indice** ») libellé en dollars des États-Unis, représentatif de la performance des actions de sociétés de grande et moyenne capitalisation des pays d'Asie, à l'exception du Japon, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant représentant la performance des valeurs de moyenne et de grande capitalisation boursière, issues des marchés développés (hors Japon) et des marchés émergents d'Asie.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice présente les mêmes caractéristiques de base que les indices MSCI. Il repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices et prend en compte les critères de segmentation par taille de capitalisation et d'investissabilité.

Il couvre environ 85 % de la capitalisation boursière ajustée du flottant des pays d'Asie (hors Japon).

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'Indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont réinvestis nets de toute retenue à la source applicable.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice utilisant les cours officiels du marché boursier de clôture pour les actions constituant l'Indice.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre)

avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux marchés actions de l'Asie.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS.

D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE

SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque lié à l'investissement dans des valeurs de moyenne capitalisation, Risque lié à l'investissement dans les pays émergents et en voie de développement, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Morgan Stanley Capital International Inc. (« MSCI »), ni aucune société affiliée de MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés affiliées et ont été concédés sous licence pour être utilisés à certaines fins par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI ne fait de déclaration ni ne donne de garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires de ce Compartiment ni au public quant à l'opportunité d'investir dans des Compartiments en général ou dans ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance générale du marché boursier. MSCI

ou 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 de ce Compartiment ou de l'émetteur ou du propriétaire de ce Compartiment. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction, au calcul de tout Indice MSCI, n'est tenue de prendre en compte les besoins de l'émetteur de ce Compartiment ou des propriétaires des actions de celui-ci lorsqu'ils déterminent, construisent ou calculent les indices MSCI.

Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction ou au calcul de tout Indice MSCI, ne prend de décision concernant la date de lancement, la fixation des prix et la quantité d'actions à émettre dans ce Compartiment, ou la détermination ou le calcul de la formule suivant laquelle les actions de ce Compartiment seront converties en liquidités. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI n'a d'obligation ou de responsabilité envers les propriétaires de ce Compartiment en ce qui concerne l'administration, la commercialisation ou 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 QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, NI MSCI, NI SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTITUTION OU À LA COMPILATION D'UN INDICE MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION INCLUSE. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE FILIALE DE CELLE-CI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, N'ACCORDE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE, LES CLIENTS DE CELUI-CI OU LES CONTREPARTIES, LES ÉMETTEURS DU FONDS, LES PROPRIÉTAIRES D' ACTIONS DU FONDS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE TIRERONT DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES EN CE QUI CONCERNE LES DROITS SUR LESQUELS PORTENT CETTE LICENCE, OU TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRA ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE D'UNE QUELCONQUE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION, DIRECTE OU INDIRECTE, DE TOUT INDICE MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI

Y SONT INCORPORÉES. EN OUTRE, NI MSCI, NI L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE DONNE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI, L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, ET TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, DÉCLINE TOUTE GARANTIE QUANT À LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UN BUT SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS MSCI, SES FILIALES OU TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRONT ÊTRE TENUES POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE PRÉJUDICE DIRECT, INDIRECT, SPÉCIAL, PUNITIF, CONSÉCUTIF, OU DE TOUT AUTRE DOMMAGE (Y COMPRIS D'UN MANQUE À GAGNER) MÊME SI ELLES ONT ÉTÉ INFORMÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 58

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI AC Asia Pacific Ex Japan

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI AC Asia Pacific Ex Japan** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI AC Asia Pacific-ex Japan Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollars des États-Unis, représentatif de la performance globale des actions de sociétés de grande et moyenne capitalisation de la région Asie-Pacifique, à l'exception du Japon, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière du flottant qui mesure la performance de segments de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (à l'exclusion du Japon) et les marchés émergents de la région Asie-Pacifique.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice présente les mêmes caractéristiques de base que les indices MSCI. Il est basé sur la méthodologie des MSCI Global Investable Market Indices en tenant compte de la méthodologie de segmentation de la taille et des exigences en matière de capacité d'investissement.

L'Indice couvre environ 85 % de la capitalisation boursière ajustée au flottant des principaux pays d'Asie-Pacifique (à l'exclusion du Japon).

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'Indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont réinvestis nets de toute retenue à la source applicable.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice utilisant les cours officiels du marché boursier de clôture pour les actions constituant l'Indice.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et

la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels à la recherche d'une exposition aux marchés d'actions d'Asie-Pacifique.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque lié à l'investissement dans des valeurs de moyenne capitalisation, Risque lié à l'investissement dans les pays émergents et en voie de développement, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Morgan Stanley Capital International Inc. (« MSCI »), ni aucune société affiliée de MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés affiliées et ont été concédés sous licence pour être utilisés à certaines fins par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI ne fait de déclaration ni ne donne de garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires de ce Compartiment ni au public quant à l'opportunité

d'investir dans des Compartiments en général ou dans ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance générale du marché boursier. MSCI ou 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 de ce Compartiment ou de l'émetteur ou du propriétaire de ce Compartiment. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction, au calcul de tout Indice MSCI, n'est tenue de prendre en compte les besoins de l'émetteur de ce Compartiment ou des propriétaires des actions de celui-ci lorsqu'ils déterminent, construisent ou calculent les indices MSCI.

Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction ou au calcul de tout Indice MSCI, ne prend de décision concernant la date de lancement, la fixation des prix et la quantité d'actions à émettre dans ce Compartiment, ou la détermination ou le calcul de la formule suivant laquelle les actions de ce Compartiment seront converties en liquidités. MSCI, toutes filiales de celle-ci et toute autre partie impliquée, ou liée à la construction ou à la création de tout Indice MSCI déclinent toute responsabilité et n'assument aucune obligation envers les propriétaires d'actions de ce Compartiment quant à l'administration, la commercialisation ou l'offre des actions de celui-ci.

BIEN QUE MSCI SE PROCURE LES DONNÉES INCORPORÉES DANS LES INDICES MSCI OU UTILISÉES POUR CALCULER CES DERNIERS AUPRÈS DE SOURCES QU'ELLE CONSIDÈRE FIABLES, NI MSCI, NI SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, NI AUCUNE DES PARTIES IMPLIQUÉES DANS, OU LIÉE À, LA RÉALISATION OU LA COMPILATION DE TOUT INDICE MSCI NE GARANTISSENT L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE FILIALE DE CELLE-CI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, N'ACCORDE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE, LES CLIENTS DE CELUI-CI OU LES CONTREPARTIES, LES ÉMETTEURS DU FONDS, LES PROPRIÉTAIRES D' ACTIONS DU FONDS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE TIRERONT DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES EN CE QUI CONCERNE LES DROITS SUR LESQUELS PORTENT CETTE LICENCE, OU TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE

POURRA ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE D'UNE QUELCONQUE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION, DIRECTE OU INDIRECTE, DE TOUT INDICE MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. EN OUTRE, NI MSCI, NI L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE DONNE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI, L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, ET TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, DÉCLINE TOUTE GARANTIE QUANT A LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UN BUT SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS MSCI, SES FILIALES OU TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRONT ÊTRE TENUES POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE PRÉJUDICE DIRECT, INDIRECT, SPÉCIAL, PUNITIF, CONSÉCUTIF, OU DE TOUT AUTRE DOMMAGE (Y COMPRIS D'UN MANQUE À GAGNER) MÊME SI ELLES ONT ÉTÉ INFORMÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 59

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Indonesia

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Indonesia** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI Indonesia Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollars des États-Unis, représentatif du marché des actions indonésien, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant représentatif de la performance des actions de grandes et moyennes capitalisations du marché indonésien.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice présente les mêmes caractéristiques de base que les indices MSCI. Il repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices et prend en compte les critères de segmentation par taille de capitalisation et d'investissabilité.

Il est représentatif de 85 % de la capitalisation boursière ajustée du flottant de chaque groupe d'industries du marché indonésien.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'Indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont réinvestis nets de toute retenue à la source applicable.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice utilisant les cours officiels du marché boursier de clôture pour les actions constituant l'Indice.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché actions indonésien.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le

Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque inhérent aux actions, Risque lié à une faible diversification, Risque lié à l'investissement dans les pays émergents et en voie de développement, Risques liés à l'investissement dans des valeurs de moyenne capitalisation, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Morgan Stanley Capital International Inc. (« MSCI »), ni aucune société affiliée de MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés affiliées et ont été concédés sous licence pour être utilisés à certaines fins par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI ne fait de déclaration ni ne donne de garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires de ce Compartiment ni au public quant à l'opportunité d'investir dans des Compartiments en général ou dans ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance générale du marché boursier. MSCI

ou 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 de ce Compartiment ou de l'émetteur ou du propriétaire de ce Compartiment. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction, au calcul de tout Indice MSCI, n'est tenue de prendre en compte les besoins de l'émetteur de ce Compartiment ou des propriétaires des actions de celui-ci lorsqu'ils déterminent, construisent ou calculent les indices MSCI. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction ou au calcul de tout Indice MSCI, ne prend de décision concernant la date de lancement, la fixation des prix et la quantité d'actions à émettre dans ce Compartiment, ou la détermination ou le calcul de la formule suivant laquelle les actions de ce Compartiment seront converties en liquidités. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI n'a d'obligation ou de responsabilité envers les propriétaires de ce Compartiment en ce qui concerne l'administration, la commercialisation ou 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 QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, NI MSCI, NI SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTITUTION OU À LA COMPILATION D'UN INDICE MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION INCLUSE. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE FILIALE DE CELLE-CI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, N'ACCORDE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE, LES CLIENTS DE CELUI-CI OU LES CONTREPARTIES, LES ÉMETTEURS DU FONDS, LES PROPRIÉTAIRES D'ACTION DU FONDS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE TIRERONT DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES EN CE QUI CONCERNE LES DROITS SUR LESQUELS PORTENT CETTE LICENCE, OU TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRA ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE D'UNE QUELCONQUE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION, DIRECTE OU INDIRECTE, DE TOUT INDICE MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. EN OUTRE, NI MSCI, NI L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, NI

UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE DONNE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI, L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, ET TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, DÉCLINE TOUTE GARANTIE QUANT À LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UN BUT SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS MSCI, SES FILIALES OU TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRONT ÊTRE TENUES POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE PRÉJUDICE DIRECT, INDIRECT, SPÉCIAL, PUNITIF, CONSÉCUTIF, OU DE TOUT AUTRE DOMMAGE (Y COMPRIS D'UN MANQUE À GAGNER) MÊME SI ELLES ONT ÉTÉ INFORMÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 60

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened** (le « **Compartiment** ») est de suivre à la fois l'évolution à la hausse et à la baisse de MSCI ACWI Semiconductors & Semiconductor Equipment ESG Filtered Net Total Return Index (l'« **Indice** ») libellé en dollars américains et représentatif d'un ensemble de sociétés sélectionnées dans MSCI ACWI Semiconductors and Semiconductor Equipment Index (l'« **Indice parent** ») qui exclut les sociétés avec des lacunes sur le plan environnemental, social et de la gouvernance (ESG) par rapport à l'Indice parent, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice vise à représenter la performance d'un ensemble sélectionné de sociétés de l'Indice parent qui exclut les sociétés qui sont en retard sur les plans environnemental, social et de gouvernance (ESG) par rapport à l'Indice parent, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère selon lequel tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

L'indice est révisé et rééquilibré sur une base semestrielle, à la clôture du dernier jour ouvrable de mai et de novembre, ce qui coïncide avec la

révision semestrielle de mai et de novembre de l'Indice parent. L'Indice peut aussi être rééquilibré en fonction des besoins, soit à la fin de toute séance au cours de laquelle les plafonds de 35 % et 20 % (sans le tampon) auront été franchis. Ce type de rééquilibrage ad hoc garantit le respect continu des plafonds de pondération fixés pour l'Indice. Le rééquilibrage aura lieu à la clôture du jour où l'Indice franchit les limites, de sorte que l'Indice soit toujours dans les limites imposées avant l'ouverture du jour de bourse suivant.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus

d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à la performance d'actions de grandes et moyennes capitalisations des secteurs des semi-conducteurs et des équipements pour semi-conducteurs, à l'exclusion des sociétés qui sont en retard sur le plan environnemental, social et de la gouvernance (ESG) par rapport à l'Indice parent.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE

NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment émet des Actions UCITS ETF. Les Actions UCITS ETF seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions UCITS ETF ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque lié à une faible diversification, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments dérivés, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque lié aux prêts de titres, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Dans la gestion des Risques en matière de durabilité du Compartiment, la Société de gestion

s'en remet à MSCI en sa qualité d'administrateur de l'Indice, dont le score et de la catégorie MSCI Low Carbon Transition identifient et intègrent les Risques en matière de durabilité pertinents et importants dans sa Méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques en matière de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice suivi par le Compartiment. Ce Compartiment est considérablement exposé aux régions qui peuvent avoir une surveillance gouvernementale ou réglementaire relativement faible ou une transparence ou une divulgation moindre des Facteurs de durabilité et peut donc être soumis à des Risques accrus en matière de durabilité. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG, veuillez consulter : www.msci.com. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Morgan Stanley Capital International Inc. (« MSCI »), ni aucune société affiliée de MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés affiliées et ont été concédés sous licence pour être utilisés à certaines fins par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI ne fait de déclaration ni ne donne de garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires de ce Compartiment ni au public quant à l'opportunité d'investir dans des Compartiments en général ou dans ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance générale du marché boursier. MSCI ou 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 de ce Compartiment ou de l'émetteur ou du propriétaire de ce Compartiment. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction, au calcul de tout Indice MSCI, n'est tenue de prendre en compte les besoins de l'émetteur de ce Compartiment ou des propriétaires des actions de celui-ci lorsqu'ils déterminent, construisent ou calculent les indices MSCI. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque

des parties impliquées ou liées à la construction ou au calcul de tout Indice MSCI, ne prend de décision concernant la date de lancement, la fixation des prix et la quantité d'actions à émettre dans ce Compartiment, ou la détermination ou le calcul de la formule suivant laquelle les actions de ce Compartiment seront converties en liquidités. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI n'a d'obligation ou de responsabilité envers les propriétaires de ce Compartiment en ce qui concerne l'administration, la commercialisation ou 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 QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, NI MSCI, NI SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTITUTION OU À LA COMPILATION D'UN INDICE MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION INCLUSE. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE FILIALE DE CELLE-CI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, N'ACCORDE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE, LES CLIENTS DE CELUI-CI OU LES CONTREPARTIES, LES ÉMETTEURS DU FONDS, LES PROPRIÉTAIRES D' ACTIONS DU FONDS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE TIRERONT DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES EN CE QUI CONCERNE LES DROITS SUR LESQUELS PORTENT CETTE LICENCE, OU TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRA ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE D'UNE QUELCONQUE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION, DIRECTE OU INDIRECTE, DE TOUT INDICE MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. EN OUTRE, NI MSCI, NI L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE DONNE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI, L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, ET TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, DÉCLINE TOUTE GARANTIE QUANT À LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UN BUT SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS MSCI, SES FILIALES OU TOUTE

AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRONT ÊTRE TENUES POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE PRÉJUDICE DIRECT, INDIRECT, SPÉCIAL, PUNITIF, CONSÉCUTIF, OU DE TOUT AUTRE DOMMAGE (Y COMPRIS D'UN MANQUE À GAGNER) MÊME SI ELLES ONT ÉTÉ INFORMÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 61

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Brazil

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Brazil** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI Brazil Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollars des États-Unis, représentatif du marché actions brésilien, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant représentatif de la performance des actions de grandes et moyennes capitalisations du marché brésilien.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice présente les mêmes caractéristiques de base que les indices MSCI. Il repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices et prend en compte les critères de segmentation par taille de capitalisation et d'investissabilité.

Il représente 85 % de la capitalisation boursière ajustée du flottant de chaque groupe d'industries du marché brésilien.

La méthodologie MSCI prend en compte un nombre variable de sociétés dans l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des valeurs composant l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution est réinvesti après déduction de toute retenue à la source applicable.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché actions brésilien.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le

Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque lié à une faible diversification, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Morgan Stanley Capital International Inc. (« MSCI »), ni aucune société affiliée de MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés affiliées et ont été concédés sous licence pour être utilisés à certaines fins par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI ne fait de déclaration ni ne donne de garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires de ce Compartiment ni au public quant à l'opportunité d'investir dans des Compartiments en général ou dans ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance générale du marché boursier. MSCI ou 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 de ce Compartiment ou de l'émetteur ou du propriétaire de ce Compartiment.

Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction, au calcul de tout Indice MSCI, n'est tenue de prendre en compte les besoins de l'émetteur de ce Compartiment ou des propriétaires des actions de celui-ci lorsqu'ils déterminent, construisent ou calculent les indices MSCI. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction ou au calcul de tout Indice MSCI, ne prend de décision concernant la date de lancement, la fixation des prix et la quantité d'actions à émettre dans ce Compartiment, ou la détermination ou le calcul de la formule suivant laquelle les actions de ce Compartiment seront converties en liquidités. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI n'a d'obligation ou de responsabilité envers les propriétaires de ce Compartiment en ce qui concerne l'administration, la commercialisation ou 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 QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, NI MSCI, NI SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTITUTION OU À LA COMPILATION D'UN INDICE MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION INCLUSE. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE FILIALE DE CELLE-CI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, N'ACCORDE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE, LES CLIENTS DE CELUI-CI OU LES CONTREPARTIES, LES ÉMETTEURS DU FONDS, LES PROPRIÉTAIRES D' ACTIONS DU FONDS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE TIRERONT DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES EN CE QUI CONCERNE LES DROITS SUR LESQUELS PORTENT CETTE LICENCE, OU TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRA ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE D'UNE QUELCONQUE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION, DIRECTE OU INDIRECTE, DE TOUT INDICE MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. EN OUTRE, NI MSCI, NI L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, NI

UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE DONNE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI, L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, ET TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, DÉCLINE TOUTE GARANTIE QUANT A LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UN BUT SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS MSCI, SES FILIALES OU TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRONT ÊTRE TENUES POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE PRÉJUDICE DIRECT, INDIRECT, SPÉCIAL, PUNITIF, CONSÉCUTIF, OU DE TOUT AUTRE DOMMAGE (Y COMPRIS D'UN MANQUE À GAGNER) MÊME SI ELLES ONT ÉTÉ INFORMÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 62

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Eastern Europe Ex Russia

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Eastern Europe Ex Russia** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI EM Eastern Europe ex Russia Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en euros, représentatif du marché actions des pays émergents de l'Europe de l'Est à l'exception de la Russie, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant représentatif de la performance des actions de grandes et moyennes capitalisations des marchés émergents de l'Europe de l'Est (à l'exception de la Russie).

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice présente les mêmes caractéristiques de base que les indices MSCI. Il repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices et prend en compte les critères de segmentation par taille de capitalisation et d'investissabilité.

Il représente approximativement 85 % de la capitalisation boursière ajustée du flottant de chaque pays émergent de l'Europe de l'Est (à l'exception de la Russie).

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des valeurs composant l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution est réinvesti après déduction de toute retenue à la source applicable.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre)

avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux marchés actions d'Europe de l'Est.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE

SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque lié à une faible diversification, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Morgan Stanley Capital International Inc. (« MSCI »), ni aucune société affiliée de MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés affiliées et ont été concédés sous licence pour être utilisés à certaines fins par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI ne fait de déclaration ni ne donne de garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires de ce Compartiment ni au public quant à l'opportunité d'investir dans des Compartiments en général ou dans ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance générale du marché boursier. MSCI

ou 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 de ce Compartiment ou de l'émetteur ou du propriétaire de ce Compartiment.

Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction, au calcul de tout Indice MSCI, n'est tenue de prendre en compte les besoins de l'émetteur de ce Compartiment ou des propriétaires des actions de celui-ci lorsqu'ils déterminent, construisent ou calculent les indices MSCI. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction ou au calcul de tout Indice MSCI, ne prend de décision concernant la date de lancement, la fixation des prix et la quantité d'actions à émettre dans ce Compartiment, ou la détermination ou le calcul de la formule suivant laquelle les actions de ce Compartiment seront converties en liquidités. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI n'a d'obligation ou de responsabilité envers les propriétaires de ce Compartiment en ce qui concerne l'administration, la commercialisation ou 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 QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, NI MSCI, NI SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTITUTION OU À LA COMPILATION D'UN INDICE MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION INCLUSE. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE FILIALE DE CELLE-CI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, N'ACCORDE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE, LES CLIENTS DE CELUI-CI OU LES CONTREPARTIES, LES ÉMETTEURS DU FONDS, LES PROPRIÉTAIRES D' ACTIONS DU FONDS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE TIRERONT DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES EN CE QUI CONCERNE LES DROITS SUR LESQUELS PORTENT CETTE LICENCE, OU TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRA ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE D'UNE QUELCONQUE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION, DIRECTE OU INDIRECTE, DE TOUT INDICE MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. EN OUTRE, NI MSCI,

NI L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE DONNE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI, L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, ET TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, DÉCLINE TOUTE GARANTIE QUANT À LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UN BUT SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS MSCI, SES FILIALES OU TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRONT ÊTRE TENUES POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE PRÉJUDICE DIRECT, INDIRECT, SPÉCIAL, PUNITIF, CONSÉCUTIF, OU DE TOUT AUTRE DOMMAGE (Y COMPRIS D'UN MANQUE À GAGNER) MÊME SI ELLES ONT ÉTÉ INFORMÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 63

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Korea

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Korea** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI Korea 20/35 Net Total Return Index (l'« **Indice** ») libellé en dollars des États-Unis, représentatif du marché actions de la Corée du Sud, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant représentatif de la performance des actions de grandes et moyennes capitalisations du marché sud-coréen.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice a les mêmes caractéristiques principales que les indices MSCI.

L'Indice est construit selon la méthodologie MSCI 20/35 Capped Indexes, conçue pour offrir une alternative aux indices purement pondérés en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant, en appliquant des pondérations maximales au titre des contraintes réglementaires.

Les indices MSCI 20/35 plafonnent à 35 % le poids de l'entité la plus représentée et à 20 % le poids de toutes les autres, avec une marge de 10 % applicable à ces plafonds lors de chaque rééquilibrage.

L'indice est construit à partir d'un indice MSCI sous-jacent, le MSCI Korea Net Total Return (l'« **Indice Parent** »). L'Indice Parent repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices et prend en compte les critères de segmentation par taille de capitalisation et d'investissabilité.

À la construction et à chaque rééquilibrage, si le poids d'une quelconque entité dans l'Indice Parent est supérieure au plafond applicable, le poids de cette entité dans l'Indice est réduit à son niveau maximal. Les titres de l'entité soumise au

plafond sont pondérés en fonction de leur capitalisation boursière corrigée du flottant. Le poids des autres titres est alors renforcé proportionnellement à leur représentation avant l'application du plafond susmentionné.

La méthodologie de construction de l'Indice implique que la performance de l'Indice une séance de négociation donnée ne sera pas nécessairement équivalente à celle de l'Indice Parent.

L'Indice représente environ 85 % de la capitalisation boursière ajustée du flottant du marché sud-coréen.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'Indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont réinvestis nets de toute retenue à la source applicable.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

La composition de l'Indice est revue et rééquilibrée trimestriellement, le dernier jour ouvré de février, mai, août et novembre, afin de coïncider avec la revue trimestrielle de l'Indice Parent. L'Indice peut aussi être rééquilibré en fonction des besoins, à la fin de toute séance au cours de laquelle les plafonds de 35 % et 20 % (sans le tampon) auront été franchis. Ce type de rééquilibrage ad hoc garantit le respect continu des plafonds de pondération fixés pour l'Indice.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une répllication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché actions sud-coréen.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs

marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension des cotations sur le Marché secondaire (comme défini plus haut dans le présent Prospectus), les droits de sortie ci-après s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque lié à une faible diversification, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Morgan Stanley Capital International Inc. (« MSCI »), ni aucune société affiliée de MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés affiliées et ont été concédés sous licence pour être utilisés à certaines fins par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI ne fait de déclaration ni ne donne de garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires de ce Compartiment ni au public quant à l'opportunité d'investir dans des Compartiments en général ou dans ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance générale du marché boursier. MSCI ou 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 de ce Compartiment ou de l'émetteur ou du propriétaire de ce Compartiment. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction, au calcul de tout Indice MSCI, n'est tenue de prendre en compte les besoins de l'émetteur de ce Compartiment ou des propriétaires des actions de celui-ci lorsqu'ils déterminent, construisent ou calculent les indices MSCI. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction ou au calcul de tout Indice MSCI, ne prend de décision concernant la date de lancement, la fixation des prix et la quantité d'actions à émettre dans ce Compartiment, ou la détermination ou le calcul de la formule suivant laquelle les actions de ce Compartiment seront converties en liquidités. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI n'a d'obligation ou de responsabilité envers les propriétaires de ce Compartiment en ce qui concerne l'administration, la commercialisation ou 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 QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, NI MSCI, NI SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTITUTION OU À LA COMPILATION D'UN INDICE MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION INCLUSE. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE FILIALE DE CELLE-CI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, N'ACCORDE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE, LES CLIENTS DE CELUI-CI OU LES CONTREPARTIES, LES ÉMETTEURS DU FONDS, LES PROPRIÉTAIRES D' ACTIONS DU FONDS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE TIRERONT DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES EN CE QUI CONCERNE LES DROITS SUR LESQUELS PORTENT CETTE LICENCE, OU TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRA ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE D'UNE QUELCONQUE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION, DIRECTE OU INDIRECTE, DE TOUT INDICE MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. EN OUTRE, NI MSCI, NI L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE DONNE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI, L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, ET TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, DÉCLINE TOUTE GARANTIE QUANT A LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UN BUT SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS MSCI, SES FILIALES OU TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRONT ÊTRE TENUES POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE PRÉJUDICE DIRECT, INDIRECT, SPÉCIAL, PUNITIF, CONSÉCUTIF, OU DE TOUT AUTRE DOMMAGE (Y COMPRIS D'UN MANQUE À GAGNER) MÊME SI ELLES ONT ÉTÉ INFORMÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 64

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Turkey

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Turkey** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI Turkey Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en dollars des États-Unis, représentatif du marché actions turque, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant représentatif de la performance des actions de grandes et moyennes capitalisations du marché turque.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice présente les mêmes caractéristiques de base que les indices MSCI. Il repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices et prend en compte les critères de segmentation par taille de capitalisation et d'investissabilité.

Il représente 85 % de la capitalisation boursière ajustée du flottant de chaque groupe d'industries du marché turc.

La méthodologie MSCI prend en compte un nombre variable de sociétés dans l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des valeurs composant l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution est réinvesti après déduction de toute retenue à la source applicable.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.msci.com

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché actions turque.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE

SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque lié à une faible diversification, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Ce Compartiment n'est pas commandité, endossé, vendu ou promu par Morgan Stanley Capital International Inc. (« MSCI »), ni aucune société affiliée de MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés affiliées et ont été concédés sous licence pour être utilisés à certaines fins par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI ne fait de déclaration ni ne donne de garantie, expresse ou implicite, aux propriétaires de ce Compartiment ni au public quant à l'opportunité d'investir dans des Compartiments en général ou dans ce Compartiment en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance générale du marché boursier. MSCI

ou 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 de ce Compartiment ou de l'émetteur ou du propriétaire de ce Compartiment. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction, au calcul de tout Indice MSCI, n'est tenue de prendre en compte les besoins de l'émetteur de ce Compartiment ou des propriétaires des actions de celui-ci lorsqu'ils déterminent, construisent ou calculent les indices MSCI. Ni MSCI, ni l'une quelconque de ses filiales, ni l'une quelconque des parties impliquées ou liées à la construction ou au calcul de tout Indice MSCI, ne prend de décision concernant la date de lancement, la fixation des prix et la quantité d'actions à émettre dans ce Compartiment, ou la détermination ou le calcul de la formule suivant laquelle les actions de ce Compartiment seront converties en liquidités. Ni MSCI, ni aucune de ses sociétés affiliées, ni aucune autre partie impliquée dans, ou liée à, la création ou la compilation d'un indice MSCI n'a d'obligation ou de responsabilité envers les propriétaires de ce Compartiment en ce qui concerne l'administration, la commercialisation ou 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 QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, NI MSCI, NI SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, NI AUCUNE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTITUTION OU À LA COMPILATION D'UN INDICE MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION INCLUSE. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE FILIALE DE CELLE-CI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, N'ACCORDE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS QUE LE TITULAIRE D'UNE LICENCE, LES CLIENTS DE CELUI-CI OU LES CONTREPARTIES, LES ÉMETTEURS DU FONDS, LES PROPRIÉTAIRES D' ACTIONS DU FONDS, OU TOUTE AUTRE PERSONNE PHYSIQUE OU MORALE TIRERONT DE L'UTILISATION DES INDICES MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES EN CE QUI CONCERNE LES DROITS SUR LESQUELS PORTENT CETTE LICENCE, OU TOUTE AUTRE FIN. NI MSCI, NI UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRA ÊTRE TENUE POUR RESPONSABLE D'UNE QUELCONQUE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION, DIRECTE OU INDIRECTE, DE TOUT INDICE MSCI OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. EN OUTRE, NI MSCI, NI L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, NI

UNE QUELCONQUE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE DONNE UNE QUELCONQUE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET MSCI, L'UNE QUELCONQUE DE SES FILIALES, ET TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, DÉCLINE TOUTE GARANTIE QUANT A LA VALEUR COMMERCIALE OU L'ADÉQUATION À UN BUT SPÉCIFIQUE DES INDICES OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉES. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, EN AUCUN CAS MSCI, SES FILIALES OU TOUTE AUTRE PARTIE IMPLIQUÉE OU LIÉE À LA CONSTRUCTION OU À LA CRÉATION DE TOUT INDICE MSCI, NE POURRONT ÊTRE TENUES POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE PRÉJUDICE DIRECT, INDIRECT, SPÉCIAL, PUNITIF, CONSÉCUTIF, OU DE TOUT AUTRE DOMMAGE (Y COMPRIS D'UN MANQUE À GAGNER) MÊME SI ELLES ONT ÉTÉ INFORMÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

ANNEXE 65

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Government Inflation-Linked Bond 1-10Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Government Inflation-Linked Bond 1-10Y** est de refléter la performance de l'indice Bloomberg Barclays Global Inflation-Linked 1-10 Year (l'« **Indice de référence** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), représentatif de la dette souveraine des pays développés émise en monnaie locale et indexée sur l'inflation, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment aura également recours à une stratégie de couverture de change mensuelle, afin de réduire l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice pondéré par la valeur de marché qui permet de mesurer la performance de la dette indexée sur l'inflation de catégorie « investment grade » émise par des gouvernements de pays développés en monnaie locale, avec une échéance résiduelle comprise entre 1 et 10 ans.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est composé d'obligations internationales indexées sur l'inflation émises en monnaie locale par des gouvernements de pays développés.

L'Indice de référence est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'indice selon le critère que tout coupon est intégré dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

La composition de l'Indice de référence est repondérée chaque mois.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le

contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

Une description exhaustive de l'Indice et de sa méthode de construction, ainsi que des informations sur sa composition et la pondération respective de ses composantes sont disponibles sur le site Internet de son fournisseur à l'adresse :

<https://www.bloombergindices.com>.

La performance suivie est mesurée par le cours de clôture de l'Indice de référence disponible sur le site Internet <https://www.bloombergindices.com>.

- **Informations supplémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision périodique et de rééquilibrage, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse : <https://www.bloombergindices.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur. Les investisseurs du Compartiment souhaitent s'exposer durablement (c'est-à-dire à acheter et conserver leurs placements) au marché de la dette indexée sur l'inflation émise en monnaie locale par les gouvernements des pays développés.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,10 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie

principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque des instruments liés à l'inflation, Risque spécifique en raison de la saisonnalité, portage et rétroactivité sur l'inflation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (conjointement « **Bloomberg** »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc, (conjointement avec ses sociétés affiliées « **Barclays** »), concédée sous licence. Bloomberg ou les concédants de Bloomberg, y compris

Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les indices Bloomberg et Barclays. Le Compartiment n'est ni agréé ni recommandé, ni vérifié par Bloomberg ou Barclays qui ne sont pas des sociétés affiliées à Amundi Asset Management.

Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers Amundi Asset Management, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci.

ANNEXE 66

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Europe ESG Leaders

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Europe ESG Leaders** est de répliquer, à la hausse comme à la baisse, l'indice MSCI Europe ESG Leaders Net Total Return (l'« **Indice** ») libellé en euro (EUR), afin de procurer une exposition à la performance des valeurs de moyenne et de grande capitalisation boursière de pays développés européens, émises par des sociétés bien notées en matière de pratiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice représente la performance des actions de moyenne et de grande capitalisation boursière des pays développés européens émises par des sociétés bien notées en matière de pratiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) par rapport aux autres acteurs du même secteur, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI.

La méthodologie MSCI et sa méthode de calcul entraînent un nombre variable de sociétés constituant l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage annuels. L'indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels afin de vérifier si les composants respectent toujours les critères d'exclusion.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet : <https://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les

droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs privés et institutionnels souhaitant avoir une exposition aux actions à moyenne comme à forte capitalisation boursière de pays développés européens, émises par des sociétés bien notées en matière de pratiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) par rapport aux autres acteurs du même secteur.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées

tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,08 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de perte de capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change de la catégorie, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des

actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG de MSCI, veuillez consulter : <http://www.msci.com>. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales dont Amundi Asset Management a acquis la licence à des fins spécifiques. Ni MSCI, ni une quelconque filiale de MSCI, et aucune des entités participant à la production ou au calcul des indices MSCI, n'a fait une quelconque déclaration ni accordé une quelconque garantie, expresse ou tacite, aux détenteurs de parts dans le Compartiment ou, de manière plus générale, au grand public quant à l'opportunité de négocier des parts de fonds d'investissement en général ou des parts de ce Compartiment en particulier, ou quant à la capacité d'un quelconque indice MSCI de reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI, n'est tenu de prendre en considération les besoins d'Amundi Asset Management ou des détenteurs d'actions du Compartiment pour déterminer, composer ou calculer les indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI ne prend aucune décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité des actions du Compartiment, ou encore la détermination et le calcul de la formule permettant d'établir la valeur liquidative du Compartiment. MSCI, les filiales de MSCI et les entités participant à la production des indices MSCI déclinent toute responsabilité et n'assument aucune obligation quant à l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI obtienne des informations intégrées ou utilisées dans le calcul des indices de la part de sources que MSCI considère comme fiables, ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création ou le calcul des indices MSCI ne garantit l'exactitude et/ou la nature exhaustive des indices ou de toute donnée incluse. Ni MSCI, ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI, ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit détenteur de licence ainsi que les contreparties, les actionnaires du

Compartiment ou toute autre personne ou entité, par l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 67

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y consiste à suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice Bloomberg MSCI Global Green Bond 1-10 Year (l'« **Indice** ») libellé en euros, afin d'offrir une exposition au marché des obligations vertes émises par des entités investment grade et libellées dans plusieurs devises, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance d'Obligations vertes émises par des entités de catégorie investment grade, libellées dans plusieurs devises et dont l'échéance résiduelle est comprise entre un et dix ans. Les obligations vertes sont émises dans l'objectif de financer des projets ayant un impact environnemental positif, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est pondéré par la valeur de marché, ce qui signifie que les pondérations des composants sont définies en fonction de l'encours de chaque obligation.

Le prix de toutes les obligations éligibles à l'indice est fixé quotidiennement par le service de tarification de

Bloomberg, BVAL, à l'exception des obligations libellées en CHF (dont le prix est fixé par SIX) et des entreprises libellées en JPY (dont le prix est fixé par JSDA).

L'Indice est calculé quotidiennement.

L'Indice est construit, administré et géré par Bloomberg.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage le dernier jour ouvrable du mois.

La fréquence des rééquilibrages telle que décrite ci-dessus aura une incidence sur les coûts au cours de la réalisation de l'objectif d'investissement. Les frais particuliers générés par ces rééquilibrages de l'Indice incluent les coûts de transaction supplémentaires. L'Indice est un indice de « rendement total » (les coupons détachés des composantes de l'Indice sont réinvestis dans celui-ci).

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant le suivi et le rééquilibrage de l'Indice et ses effets sur les coûts de la stratégie) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet :

www.bloomberg.com/indices.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet www.bloomberg.com/indices.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme

indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition au marché des obligations vertes.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de

négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 2 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Absence d'historique, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'Objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la catégorie, Risque de marché lié à une controverse, Risque de calcul de l'indice.

LIMITES DE L'APPROCHE EXTRA-FINANCIÈRE

L'approche extra-financière mise en œuvre par le Compartiment repose en grande partie sur des données de tiers qui peuvent être parfois incomplètes, inexactes ou indisponibles. La Société de gestion est donc dépendante de la qualité et de la fiabilité de ces informations. Enfin, les investissements dans les obligations vertes peuvent induire des biais sectoriels sur le marché obligataire mondial.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Dans la gestion des Risques en matière de durabilité du Compartiment, la Société de gestion s'en remet à Bloomberg en sa qualité d'administrateur de l'Indice, dont la Méthode de construction de l'Indice identifie et intègre les Risques en matière de durabilité pertinents et importants. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations sur la méthodologie de l'Indice, veuillez vous référer à : www.bloomberg.com/indices. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

BLOOMBERG, BLOOMBERG INDICES et Bloomberg Fixed Income Indices (les « Indices ») sont des marques commerciales ou des marques de service de Bloomberg Finance L.P. Bloomberg Finance L.P. et ses sociétés affiliées, y compris Bloomberg Index Services Limited, l'administrateur des Indices (collectivement, « Bloomberg ») ou les concédants de Bloomberg qui détiennent tous les droits de propriété sur les Indices. Bloomberg ne garantit pas l'actualité, l'exactitude ou l'exhaustivité de toute donnée ou information relative à l'Indice, et ne sera en aucun cas responsable vis-à-vis de Amundi Asset Management, des investisseurs du Compartiment ou d'autres tiers en ce qui concerne l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice ou de toute donnée incluse dans celui-ci.

ANNEXE 68

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Ex China

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Ex China** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI Emerging Markets Ex China Net Total Return (dividendes nets réinvestis) (l'« **Indice** »), libellé en dollars des États-Unis (USD), qui est représentatif de la performance des sociétés de grande et moyenne capitalisation des pays émergents autres que la Chine, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice de capitalisation boursière pondéré par le flottant qui est conçu pour mesurer la performance des segments grandes et moyennes capitalisations des marchés émergents à l'exclusion de la Chine.

L'Indice a comme objectif de représenter 85 % de la capitalisation boursière ajustée en fonction du flottant de chaque pays émergent.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices international MSCI.

L'Indice repose sur la méthodologie MSCI Global Investable Market Indices, qui prend en compte la taille, la liquidité et le flottant minimal requis pour les valeurs faisant partie de l'univers d'investissement.

L'Indice se compose exclusivement d'actions de marchés émergents et représente les grandes et moyennes capitalisations issues des pays émergents du monde entier hors Chine.

La méthodologie MSCI et la méthode de calcul sont basées sur un nombre variable de sociétés de l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus

dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Le Compartiment peut, à titre accessoire, détenir des liquidités et avoirs équivalents dans les limites énoncées dans le présent Prospectus.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi

allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition de base à long terme à la performance des grandes et moyennes capitalisations dans les pays émergents autres que la Chine.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur <http://www.amundiETF.com>.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque lié à une faible diversification, Risque sur les investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. Ce Compartiment est considérablement exposé aux régions qui peuvent avoir une surveillance gouvernementale ou réglementaire relativement faible ou une transparence ou une divulgation moindre des Facteurs de durabilité et peut donc être soumis à des Risques accrus en matière de durabilité. De plus amples informations sont disponibles à la section du Prospectus intitulée « PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ ».

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées

dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 69

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Government Bond II

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Government Bond II** (le « **Compartiment** ») consiste à refléter la performance de l'indice FTSE G7 and EMU Government Bond Index – Developed Markets (l'« **Indice de référence** ») libellé en dollar des États-Unis, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment aura également recours à une stratégie de couverture de change mensuelle, afin de réduire l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composant de l'Indice de référence.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice pondéré par la valeur de marché qui permet de mesurer la performance de la dette souveraine de catégorie « investment grade » émise en monnaie locale par les gouvernements des pays développés.

L'Indice de référence représente les emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis en monnaie locale par les gouvernements des pays développés.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est promu par le fournisseur d'indices internationaux FTSE Russell.

L'Indice de référence est composé d'obligations internationales émises en monnaie locale par les gouvernements des pays développés. Dans le cadre de la famille d'indices World Government Bond Index (WGBI), une obligation doit, pour pouvoir être incluse dans l'Indice de référence, satisfaire à des critères spécifiques concernant son coupon, échéance, encours, volume d'émission et sa qualité de crédit.

L'Indice de référence est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <https://www.yieldbook.com/m/indexes/fund/>.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'un rééquilibrage mensuel.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations supplémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.yieldbook.com/m/indexes/fund/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent s'exposer durablement (c'est-à-dire à acheter et conserver leurs placements) à la performance des emprunts d'État de qualité investment grade émis en monnaie locale par les gouvernements des pays développés.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,2 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie

principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment a été développé exclusivement par Amundi Asset Management. Le Compartiment n'est ni lié à, ni recommandé, ni vendu, ni promu par le London Stock Exchange Group plc et ses sociétés (collectivement, le « Groupe LSE »). FTSE Russell est le nom commercial de certaines sociétés du Groupe LSE.

Tous les droits sur l'indice FTSE G7 and EMU Government Bond – Developed Markets (l'« **Indice** ») appartiennent à la société du Groupe LSE, qui est propriétaire de l'Indice. « FTSE® », « FTSE Russell® » et « The Yield Book® » sont des marques commerciales de la société du Groupe LSE concernée et sont utilisées sous licence par toute autre société du Groupe LSE.

L'Indice est calculé par FTSE Fixed Income, LLC, ou sa société affiliée, son agent ou son partenaire, ou pour leur compte. Le Groupe LSE n'assume aucune responsabilité quelle qu'elle soit découlant a) de l'utilisation d'un indice, de la confiance accordée à celui-ci ou de toute erreur dans celui-ci ou b) d'un investissement dans le Compartiment ou de la gestion de celui-ci. Le Groupe LSE ne formule aucune affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie quant aux résultats futurs du Compartiment ou à l'adéquation de l'Indice à la finalité pour laquelle il est utilisé par Amundi Asset Management.

ANNEXE 70

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core Japanese Government Bond (DR) UCITS ETF

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le yen (JPY).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core Japanese Government Bond (DR) UCITS ETF** (le « **Compartiment** ») consiste à refléter la performance de l'indice FTSE Japanese Government Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en yen japonais, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées dans l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment aura également recours à une stratégie de couverture de change mensuelle, afin de réduire l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composant de l'Indice de référence.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice pondéré par la valeur de marché qui permet de mesurer la performance de la dette souveraine de catégorie « investment grade » émise en yen par le gouvernement du Japon.

L'Indice de référence représente les emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis en yen par le gouvernement du Japon.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est promu par le fournisseur d'indices internationaux FTSE Russell.

L'Indice de référence est composé d'obligations internationales émises en yen par le gouvernement du Japon. Dans le cadre de la famille d'indices World Government Bond Index (WGBI), une obligation doit, pour pouvoir être incluse dans l'Indice de référence, satisfaire à des critères spécifiques concernant son coupon, échéance, encours, volume d'émission et sa qualité de crédit.

L'Indice de référence est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <https://www.yieldbook.com/m/indexes/fund/>.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'un rééquilibrage mensuel.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- **Informations supplémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.yieldbook.com/m/indexes/fund/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Les investisseurs du Compartiment souhaitent s'exposer durablement (c'est-à-dire à acheter et conserver leurs placements) à la performance des emprunts d'État de qualité investment grade émis en yen par le gouvernement japonais.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

La Commission de gestion du Compartiment ne devrait pas être le seul critère motivant la souscription : l'efficacité du Compartiment, représentée par l'écart de performance, l'écart de suivi et les mesures clés de la liquidité des marchés secondaires, devraient également faire l'objet de l'analyse. Les investisseurs sont invités à évaluer leur situation personnelle et leurs contraintes avant d'investir

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

0,25 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, risque de perte en capital, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque lié à une faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment a été développé exclusivement par Amundi Asset Management. Le Compartiment n'est ni lié à, ni recommandé, ni vendu, ni promu par le London Stock Exchange Group plc et ses sociétés (collectivement, le « **Groupe LSE** »). FTSE Russell est le nom commercial de certaines sociétés du Groupe LSE.

Tous les droits sur l'indice FTSE Japanese Government Bond (l'« **Indice** ») appartiennent à la société du Groupe LSE qui est propriétaire de l'Indice. « FTSE® », « FTSE Russell® » et « The Yield Book® » sont des marques commerciales de la société du Groupe LSE concernée et sont utilisées sous licence par toute autre société du Groupe LSE. L'Indice est calculé par FTSE Fixed Income, LLC, ou sa société affiliée, son agent ou son partenaire, ou pour leur compte. Le Groupe LSE n'assume aucune responsabilité quelle qu'elle soit découlant a) de l'utilisation d'un indice, de la confiance accordée à celui-ci ou de toute erreur dans celui-ci ou b) d'un investissement dans le Compartiment ou de la gestion de celui-ci. Le Groupe LSE ne formule aucune affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie quant aux résultats futurs du Compartiment ou à l'adéquation de l'Indice à la finalité pour laquelle il est utilisé par Amundi Asset Management.

ANNEXE 71

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Curve steepening 2-10Y

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi US Curve steepening 2-10Y** is to reflect the performance of the Solactive USD Daily (x7) Steepener 2-10 Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en dollar des États-Unis (USD), qui est représentatif de la performance d'une position acheteuse en contrats à terme standardisés sur les bons du Trésor américain à deux ans (contrat à 2 ans) et d'une position vendeuse en contrats à terme standardisés sur les bons du Trésor américain à dix ans (contrat à 10 ans), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est représentatif de la performance d'une position acheteuse (longue) en contrats à terme standardisés (futures) sur les bons du Trésor américain à 2 ans (contrat à 2 ans) et d'une position vendeuse (courte) sur les contrats Ultra 10Y US Treasury Note (contrat à 10 ans). L'Indice de référence devrait dès lors bénéficier d'une augmentation de l'écart entre le rendement du bon du Trésor américain à 10 ans et celui à 2 ans. À l'inverse, si cet écart se réduit, l'Indice de référence devrait baisser.

La stratégie que l'Indice de référence vise à répliquer est communément appelée stratégie de pentification en raison du fait qu'elle bénéficie de la pentification de la courbe des taux d'intérêt américains.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est construit de façon à procurer une exposition à une position longue en contrats de futures sur les bons du Trésor américain

à 2 ans (contrat à 2 ans) et à une position courte sur les contrats Ultra 10Y US Treasury Note (contrat à 10 ans).

Lors du rééquilibrage, la pondération de chaque contrat est inversement proportionnelle à sa Duration modifiée (c.-à-d. la duration modifiée de l'obligation la moins chère à livrer pour chaque contrat), ce qui permet d'éliminer les éventuels effets indésirables liés à la duration résiduelle de la stratégie. En outre, un multiplicateur de 7 sera appliqué à la poche courte et à la poche longue de façon à obtenir une position long/short à effet de levier.

La performance journalière de l'Indice de référence ne sera pas mesurée par la variation journalière de l'écart de rendement entre les échéances à 2 et 10 ans, ni par un multiplicateur de cet écart, mais elle sera liée à la surperformance journalière de la position longue en contrats de futures sur les bons du Trésor américain à 2 ans (contrat à 2 ans) par rapport à la position courte sur l'Ultra 10Y US Treasury Note Futures (contrat à 10 ans) et au rendement des liquidités, qui est théoriquement corrélée à l'évolution de l'écart de rendement entre les échéances à 2 et 10 ans.

L'Indice de référence représente donc une position longue financée en contrats de futures sur les bons du Trésor américain à deux ans (contrat à 2 ans) et une position courte sur l'Ultra 10Y US Treasury Note Futures (contrat à 10 ans).

En théorie, une diminution de l'écart de rendement entre les échéances à 2 et 10 ans entraîne une diminution relative de la valeur de la position ajustée de la duration en contrats de futures sur les bons du Trésor américain à deux ans (contrat à 2 ans) par rapport à celle sur l'Ultra 10Y US Treasury Note Futures (contrat à 10 ans). Les contrats de futures étant basés sur un panier d'obligations, la performance de l'Indice de référence ne sera pas strictement liée à l'écart de rendement entre les échéances à 2 et 10 ans, mais plutôt à celui existant entre l'obligation la moins chère à livrer du contrat de futures Ultra 10Y US Treasury Note (contrat à 10 ans) et l'obligation équivalente du contrat de futures sur les bons du Trésor américain à deux ans (contrat à 2 ans). En outre, (i) les fluctuations de prix découlant des divergences d'offre et de demande entre les obligations nominales et les contrats de futures et (ii) les frais de transaction applicables aux composantes de l'Indice de référence donneront lieu à des écarts entre la performance de l'Indice de référence et l'évolution de la pente de la courbe.

La composition de l'Indice de référence est ajustée quotidiennement et repondérée chaque trimestre.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <http://www.Solactive.de>.

- **Informations supplémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <http://www.Solactive.de>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur.

Il est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant avoir une exposition à l'évolution de la pentification de la courbe des taux américains par le biais d'une position longue en contrats de futures sur les bons du Trésor américain à deux ans (contrat à 2 ans) et d'une position courte sur l'Ultra 10Y US Treasury Note Futures (contrat à 10 ans).

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différences modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

GESTION DES RISQUES

Par dérogation aux dispositions du paragraphe Processus de gestion des risques de la partie principale du Prospectus, l'exposition globale de ce Compartiment est calculée selon la méthode de la VaR absolue telle qu'elle est décrite en détail dans la législation et la réglementation en vigueur, y compris, de façon non limitative, la Circulaire 11/512 de la CSSF.

Le niveau de levier escompté du Compartiment (égal à la somme des montants notionnels de l'exposition longue et de l'exposition courte de l'Indice de référence augmentée de l'exposition aux liquidités de l'Indice) est de 560 % ; celui-ci s'appuie sur une moyenne calculée à partir d'un historique établi par le promoteur de l'Indice de référence, même si des niveaux supérieurs peuvent être observés. Des niveaux d'effet de levier supérieurs sont possibles suivant la mise en œuvre de la Méthode de construction de l'Indice de référence et les ajustements quantitatifs prévus par celle-ci.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risques liés aux contrats à terme standardisés composant l'indice/la stratégie, Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque de perte en capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change d'une catégorie d'actions, Risque lié au calcul de l'Indice.

En outre, le Compartiment est exposé au risque suivant :

Risque lié au renouvellement des contrats à terme standardisés

L'Indice de référence est composé de contrats à terme standardisés sur emprunts d'État. Les positions sur ces contrats seront reconduites. Cette opération consiste à transférer une position sur des contrats proches de leur échéance (ce transfert intervenant dans tous les cas avant l'expiration des contrats) sur des contrats d'échéance plus éloignée. En raison des coûts de transaction et du manque de liquidité potentiel, les investisseurs sont exposés à un risque de perte découlant du renouvellement des contrats à terme.

Risque lié à l'effet de levier

En répliquant la performance de l'Indice de référence, le Compartiment sera indirectement exposé aux contrats à terme standardisés sur les obligations américaines via son exposition à l'Indice de référence. L'effet de levier engendre des risques spécifiques. En effet, il amplifie les mouvements des actifs sous-jacents à la hausse comme à la baisse, ce qui accroît la volatilité du Compartiment. Un niveau de levier important implique qu'une baisse modérée d'un ou de plusieurs actifs sous-jacent(s) pourrait entraîner une perte de capital importante pour le Compartiment. Enfin, l'effet de levier implique une hausse proportionnelle des coûts d'investissement du Compartiment, en particulier les coûts de transaction.

Risque lié au réajustement quotidien du levier

Les Investisseurs sont exposés aux fluctuations qui affectent le prix ou le niveau des composantes longue et courte sur une base quotidienne. Le rééquilibrage quotidien de l'Indice de référence implique que pendant une durée de plus d'un jour de négociation (une « Période »), la performance totale de l'Indice de référence peut ne pas correspondre à la différence entre la performance de la composante longue et celle de la composante courte.

Il convient de noter que les scénarios de simulation présentés ci-dessous le sont à titre indicatif et ne prennent pas en compte plusieurs facteurs (rendement des liquidités, coûts de transaction, etc.). En outre, dans ces exemples, le multiplicateur est intégré à la performance des composantes longue et courte.

Par exemple, dans le scénario n°1 ci-après, si la composante longue s'apprécie de 3 % et la composante courte de 6 % un jour donné, puis la première recule de 5 % le jour suivant tandis que la seconde augmente de 3 %, après ces deux jours, la composante longue affichera un recul de 2,15 % et celle courte une hausse de 9,18 % sur la Période (au final, l'écart entre la composante longue et la composante courte ressort à -11,33 %), alors que l'Indice de référence aura reculé de 10,76 % (avant déduction des frais et commissions) sur la même Période.

Scénario 1 Cas où le ratio entre la performance de l'Indice de référence et le différentiel (Performance de la composante longue – Performance de la composante courte) est inférieur à 1.

	Composante longue		Composante courte		Indice de référence		Perf. Indice de référence / (Perf. comp. longue - comp. courte)
	performance le jour i	valeur le jour i	performance le jour i	valeur le jour i	performance le jour i	valeur le jour i	
		100		100		100	
Jour 1	3 %	103	6 %	106	-3 %	97,0	x1
Jour 2	-5 %	97,9	3 %	109,2	-8 %	89,2	x1
Période	-2,15 %		9,18 %		-10,76 %		x0,95

Par exemple, dans le scénario n°2 ci-après, si la composante longue s'apprécie de 5 % et la composante courte de 1 % un jour donné, puis la première recule de 5 % et la seconde de 8 % le jour suivant, après ces deux jours, la composante longue affichera un recul de -0,25 % et celle courte de -7,08 % sur la Période (au final, l'écart entre la composante longue et la composante courte ressort à 6,83 %), alors que l'Indice de référence aura reculé de 7,12 % (avant déduction des frais et commissions) sur la même Période.

Scénario 2 Cas où le ratio entre la performance de l'Indice de référence et le différentiel (Performance de la composante longue – Performance de la composante courte) est supérieur à 1.

	Composante longue		Composante courte		Indice de référence		Perf. Indice de référence / (Perf. comp. longue - comp. courte)
	performance le jour i	valeur le jour i	performance le jour i	valeur le jour i	performance le jour i	valeur le jour i	
		100		100		100	
Jour 1	5 %	105	1 %	101	4 %	104,0	x1,0
Jour 2	-5 %	99,8	-8 %	92,9	3 %	107,1	x1,0
Période	-0,25 %		-7,08 %		7,12 %		x1,04

Et dans le scénario n°3 ci-après, ce mécanisme pourrait conduire à une performance négative de l'Indice de référence de 0,56 % sur la Période, alors que la composante longue s'apprécie de 2,82 % et celle courte de 1,37 % (écart de performance entre composante longue et composante courte de +1,45 %).

Scénario 3 Cas où le ratio entre la performance de l'Indice de référence et le différentiel (Performance de la composante longue – Performance de la composante courte) est négatif.

	Composante longue		Composante courte		Indice de référence		Perf. Indice de référence / (Perf. comp. longue - comp. courte)
	performance le jour i	valeur le jour i	performance le jour i	valeur le jour i	performance le jour i	valeur le jour i	
		100		100		100	
Jour 1	-3 %	97	9 %	109	-12 %	88,0	x1,0
Jour 2	6 %	102,8	-7 %	101,4	13 %	99,4	x1,0
Période	2,82 %		1,37 %		-0,56 %		x-0,39

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni parrainé, promu, vendu ou soutenu de quelque autre manière par Solactive AG. De même, Solactive AG ne donne à aucun moment une quelconque garantie ou assurance, expresse ou tacite, quant aux résultats obtenus en utilisant l'Indice et/ou la marque de l'Indice ou son cours, ou à tout autre égard. L'Indice est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait tout ce qui est en son pouvoir pour que l'Indice soit calculé correctement. Indépendamment de ses obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'a aucune obligation de signaler les erreurs de l'Indice à des tiers, y compris, mais sans s'y limiter, aux investisseurs et/ou aux intermédiaires financiers du Compartiment. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG, ni l'octroi d'une licence portant sur l'Indice ou sa marque en vue de son utilisation aux fins du Compartiment n'a valeur de recommandation d'un investissement dans le Compartiment par Solactive AG, et ils n'impliquent en aucune manière une garantie ou un avis de Solactive AG à l'égard de tout investissement dans le Compartiment. Solactive AG décline toute responsabilité quant aux conséquences liées à l'utilisation de tout avis ou déclaration contenus aux présentes ou quant à toute omission.

ANNEXE 72

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement du **MULTI UNITS LUXEMBOURG - Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF** (le « **Compartiment** ») consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du MSCI Europe ESG Climate Transition (EU CTB) Select Net Total Return Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, et représentatif de la performance d'une stratégie d'investissement dérivée du MSCI Europe Index (l'« **Indice parent** ») et conçue pour dépasser les normes minimales des Indices de référence pour la transition climatique de l'UE (les « **CTB de l'UE** ») requises par les actes délégués complétant le Règlement (UE) 2019/2089 et modifiant le Règlement (UE) 2016/1011 (le « **Règlement de référence** »), tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Erreur de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

• **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est basé sur l'Indice parent et inclut des titres de grande et moyenne capitalisation des marchés d'actions développés d'Europe. Il vise à représenter la performance d'une stratégie d'investissement conçue pour dépasser les normes minimales des CTB de l'UE en vertu du Règlement relatif aux indices de référence. Il intègre des critères ESG et un large éventail d'objectifs liés au climat couvrant le risque de transition, les opportunités liées au changement climatique et le risque physique, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus, tout en

minimisant la volatilité de la différence entre le rendement de l'Indice et le rendement de l'Indice parent.

• **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI. La méthodologie MSCI et la méthode de calcul sont basées sur un nombre variable de sociétés de l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant l'actualisation et le rééquilibrage de sa composition) peut être consultée sur le site Internet de MSCI à l'adresse suivante : <http://www.msci.com>.

L'Indice fait l'objet d'un rééquilibrage semestriel, à la clôture du dernier jour ouvré de mai et de novembre, des dates qui coïncident avec la révision semestrielle des indices MSCI Global Investable Market.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

• **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM.

Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels à la recherche d'une exposition aux sociétés des marchés d'actions développés d'Europe. Il vise à représenter la performance d'une stratégie d'investissement conçue pour dépasser les normes minimales des CTB de l'UE en vertu du Règlement Benchmark et intègre des critères ESG et un large éventail d'objectifs liés au climat.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de

valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque d'érosion du capital, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risques liés à l'investissement dans des actions de moyennes capitalisations, Manque de réactivité face à l'évolution des circonstances, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'indice.

Le Compartiment sera également soumis aux risques suivants :

Risque de retrait du label CTB de l'UE

L'Indice a été conçu pour être éligible au label « CTB de l'UE ». Par conséquent, il devrait recevoir le label CTB de l'UE associé. Pour que l'Indice satisfasse au Règlement Benchmark, l'Indice doit, entre autres contraintes, réduire son intensité carbone à 7 % d'une année sur l'autre, en utilisant des pondérations moyennes tout au long de la période. L'Indice est conçu pour être conforme à chaque rééquilibrage. Cependant, les pondérations des sociétés, leurs émissions de carbone et leur valeur d'entreprise (qui est le dénominateur dans le calcul de l'intensité carbone) peuvent changer entre les rééquilibrages. Pour éviter toute ambiguïté, la réglementation garantit que le rapport d'indice est basé sur les pondérations moyennes entre les rééquilibrages. Par conséquent, même si l'Indice est conforme à chaque rééquilibrage, il peut ne pas nécessairement conserver le label sur la base de rapports utilisant des pondérations moyennes. En outre, dans une situation où un trop grand nombre de sociétés de l'Indice parent augmentent leurs émissions absolues de carbone sur une longue période, l'Indice pourrait ne pas respecter certaines normes minimales des CTB de l'UE et ainsi perdre son label.

Risque d'optimisations insolubles

La méthodologie de l'Indice utilise une méthodologie d'optimisation. En cas d'optimisation, il n'est pas toujours possible de trouver une solution qui réponde simultanément à toutes les contraintes. Il est prudent de garder à l'esprit que les augmentations de futures réductions relatives de l'empreinte carbone, ou les changements imprévisibles dans les exclusions ou d'autres ensembles de données, peuvent éventuellement provoquer des optimisations insolubles à l'avenir. Pour cette raison, une hiérarchie de relaxation de contraintes a été établie dans la méthodologie de l'Indice afin de minimiser davantage le risque de solutions insolubles.

Risque de consolidation illimitée sur la différence entre les pondérations des composantes de l'Indice parent

La fonction objectif de l'optimisation est de minimiser la différence de pondération des composantes par rapport à l'Indice parent, ce qui devrait minimiser l'impact des contraintes de décarbonation sur l'erreur de suivi entre l'Indice et l'Indice parent. Cependant, toute stratégie alignée sur un scénario à 1,5 °C est accompagnée d'un objectif de décarbonation absolu qui doit être atteint pour parvenir à cet alignement à 1,5 °C. Étant donné que le niveau de réduction des émissions requis pour un scénario à 1,5 °C est absolu (comme indiqué par le TEG (le Groupe technique d'experts de l'UE sur la finance durable, 2019)), l'Indice est conçu pour décarboner de 7,35 % d'une année sur l'autre. La réduction relative de l'empreinte carbone requise, à tout moment, pour atteindre cet objectif, dépendra donc de la décarbonation de l'Indice parent. La réduction de l'empreinte carbone requise serait amplifiée par un manque de décarbonation (ou une empreinte carbone accrue) dans l'Indice parent. Un tel scénario

peut nécessiter un niveau croissant de différence de pondération des composantes par rapport à l'Indice parent au fil du temps pour atteindre l'objectif souhaité. Par conséquent, une erreur de suivi historique et contre-véifiée peut ne pas être totalement indicative d'une erreur de suivi future, réalisée si une telle situation devait devenir particulièrement extrême. Étant donné que la limite supérieure de la différence de pondération des composantes de l'Indice parent n'est pas contrôlée pour éviter que les contraintes de décarbonation ci-dessus deviennent impossibles, l'erreur de suivi futur entre l'Indice et l'Indice parent ne peut jamais être complètement plafonnée.

Risque lié aux données carbone utilisées dans la méthodologie de l'Indice

L'analyse des émissions actuelles et futures de gaz à effet de serre des sociétés repose en partie sur des données, modèles et estimations déclaratives. Dans l'état actuel des données disponibles, toutes les données sur les émissions de gaz à effet de serre ne sont pas disponibles et certaines sont basées sur des modèles (en particulier celles liées à la portée 3 qui inclut toutes les émissions de gaz à effet de serre qui ne sont pas directement liées à la fabrication d'un produit).

Risque lié aux composantes de l'Indice

La méthodologie de l'Indice n'empêche pas l'intégration de titres de sociétés émettrices de gaz à effet de serre.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques en matière de durabilité de ce Compartiment, la Société de Gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques en matière de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie. Une telle intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de MSCI, veuillez consulter : <http://www.msci.com>. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été

concedés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 73

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core US Government Bond (DR) UCITS ETF

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Core US Government Bond (DR) UCITS ETF** (le « Compartiment ») consiste à refléter la performance de l'indice FTSE US Government Bond Index (l'« **Indice de référence** ») libellé en dollar des États-Unis, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice de référence (l'« Écart de suivi »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C - RÉCAPITULATIF DES ACTIONS ET DES FRAIS, le Compartiment appliquera également une stratégie de couverture de change mensuelle afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice de référence.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE**Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est un indice pondéré par la valeur de marché qui permet de mesurer la performance de la dette souveraine de catégorie « investment grade » émise en dollar des États-Unis par le gouvernement américain.

L'Indice de référence représente les emprunts d'État à taux fixe de qualité investment grade émis en dollar par le gouvernement américain. Il procure une exposition « cœur de portefeuille » nécessitant une approche « buy-and-hold ».

Méthodologie de l'Indice de référence

L'Indice de référence est promu par le fournisseur d'indices internationaux FTSE Russell.

L'Indice de référence est composé d'obligations internationales émises en dollar des États-Unis par le gouvernement américain. Dans le cadre de la famille d'indices World Government Bond Index (WGBI), une obligation doit, pour pouvoir être incluse dans l'Indice de référence, satisfaire à des critères spécifiques concernant son coupon, échéance, encours, volume d'émission et sa qualité de crédit.

L'Indice de référence est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la

performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <https://www.yieldbook.com/m/indexes/fund/>.

La composition de l'Indice de référence fait l'objet d'un rééquilibrage mensuel.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

Informations supplémentaires sur l'Indice de référence

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse : <https://www.yieldbook.com/m/indexes/fund/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RATIOS D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUES pour obtenir

des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur. Les investisseurs du Compartiment souhaitent s'exposer durablement (c'est-à-dire à acheter et conserver leurs placements) à la performance des emprunts d'État de qualité investment grade émis en dollar des États-Unis par le gouvernement américain.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 0,2 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Capital à risque, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à une faible diversification, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion de la garantie, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de calcul de l'indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment a été développé exclusivement par Amundi Asset Management. Le Compartiment n'est en aucune façon lié à, ni parrainé, cautionné, distribué ou promu par le London Stock Exchange Group plc et ses sociétés (collectivement, le « Groupe LSE »). FTSE Russell est le nom commercial de certaines sociétés du Groupe LSE. Tous les droits sur l'Indice de référence appartiennent à la société du Groupe LSE qui est propriétaire de l'Indice. « FTSE® », « FTSE Russell® » et « The Yield Book® » sont des marques commerciales de la société du Groupe LSE.

concernée et sont utilisées sous licence par toute autre société du Groupe LSE.

L'Indice de référence est calculé par FTSE Fixed Income, LLC, ou sa société affiliée, son agent ou son partenaire, ou pour leur compte. Le Groupe LSE n'assume aucune responsabilité quelle qu'elle soit découlant a) de l'utilisation d'un indice, de la confiance accordée à celui-ci ou de toute erreur dans celui-ci ou b) d'un investissement dans le Compartiment ou de la gestion de celui-ci.

Le Groupe LSE ne formule aucune affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie quant aux résultats futurs du Compartiment ou à l'adéquation de l'Indice de référence à la finalité pour laquelle il est utilisé par Amundi Asset Management.

ANNEXE 74

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return (l'« **Indice** »), libellé en euros, qui est représentatif de la performance d'actions éligibles de l'indice S&P Eurozone LargeMidCap (l'« **Indice parent** ») sélectionnées et pondérées de façon à former un univers compatible avec un scénario de réchauffement climatique planétaire de 1,5 °C, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Daily Hedged mentionnées à l'ANNEXE C - RÉCAPITULATIF DES ACTIONS ET DES FRAIS, le Compartiment appliquera également une stratégie de couverture de change quotidienne afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est basé sur l'Indice parent qui représente les titres de moyennes et grandes capitalisations issues des marchés actions de la zone euro. L'Indice mesure la performance de titres de participation éligibles de l'Indice parent, sélectionnés et pondérés pour être compatibles collectivement avec un scénario de réchauffement climatique mondial de 1,5 °C. Il intègre un large éventail d'objectifs liés au climat couvrant le risque de transition, les opportunités de changement climatique et le risque physique, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

L'Indice a été conçu pour s'aligner sur les normes minimales telles que proposées dans le Rapport final du Groupe technique d'experts de l'Union européenne sur les indices de référence climatiques

et les divulgations ESG (le « **TEG** ») et est éligible au label Indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris (« **EU PAB** »). Les propositions contenues dans le Rapport final ne sont pas juridiquement contraignantes. Le rapport final servira de base à la Commission européenne pour rédiger des actes délégués visant à mettre en œuvre les exigences du Règlement (UE) 2019/2089. À la suite de la publication des actes délégués finaux, la méthodologie sera révisée et mise à jour si nécessaire afin de s'aligner sur toute modification pertinente des normes minimales pour les indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris. Si un changement de méthodologie s'avérait nécessaire, les S&P Dow Jones Indices émettraient une annonce avant la mise en œuvre du changement (et, dans ces circonstances, les S&P Dow Jones Indices n'effectueraient pas de consultation formelle).

- **Méthodologie de l'Indice**

La performance suivie est basée sur les cours de clôture de l'Indice.

L'Indice est calculé par les S&P Dow Jones Indices.

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant son rééquilibrage et l'actualisation de sa composition) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet suivant : www.spindices.com.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels (en mars, juin, septembre et décembre).

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'Indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : www.spindices.com.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA), ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Ce Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels souhaitant s'exposer aux actions de moyennes et grandes capitalisations de la zone euro, sélectionnées et pondérées de façon à former un univers compatible avec un scénario de réchauffement climatique planétaire de 1,5°C.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de perte en capital, Risque lié aux actions, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de change, Manque de réactivité face à l'évolution des circonstances, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Manque d'historique d'exploitation, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque lié au calcul de l'Indice.

En outre, le Compartiment est exposé au risque suivant :

Risque de retrait du label EU PAB

L'Indice a été conçu pour être éligible au label « Indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris » (« **EU PAB** »).

Par conséquent, il devrait recevoir le label européen EU PAB associé. Pour que l'Indice satisfasse à la réglementation, l'Indice doit, entre autres contraintes, réduire son intensité carbone à 7 % d'une année sur l'autre, en utilisant des pondérations moyennes tout au long de la période. L'Indice est conçu pour être conforme à chaque rééquilibrage. Cependant, les pondérations des sociétés, leurs émissions de carbone et leur valeur d'entreprise (qui est le dénominateur dans le calcul de l'intensité carbone) peuvent changer entre les rééquilibrages. Pour éviter toute ambiguïté, la réglementation garantit que le rapport d'indice est basé sur les pondérations moyennes entre les rééquilibrages. Par conséquent, même si l'Indice est conforme à chaque rééquilibrage, il peut ne pas nécessairement conserver le label sur la base de rapports utilisant des pondérations moyennes. En outre, dans une situation où un trop grand nombre de sociétés de l'Indice parent augmentent leurs émissions absolues de carbone sur une longue période, l'Indice pourrait ne pas respecter certaines normes minimales des indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris et ainsi perdre son label.

Risque d'optimisations insolubles

La méthodologie de l'Indice utilise une méthodologie d'optimisation. En cas d'optimisation, il n'est pas toujours possible de trouver une solution qui réponde simultanément à toutes les contraintes. Il est prudent de garder à l'esprit que les augmentations de futures réductions relatives de l'empreinte carbone, ou les changements imprévisibles dans les exclusions ou d'autres ensembles de données, peuvent éventuellement provoquer des optimisations insolubles à l'avenir. Pour cette raison, une

hiérarchie de relaxation de contraintes a été établie dans la méthodologie de l'Indice afin de minimiser davantage le risque de solutions insolubles.

Risque de consolidation illimitée sur la différence entre les pondérations des composantes de l'Indice parent

La fonction objectif de l'optimisation est de minimiser la différence de pondération des composantes par rapport à l'Indice parent, ce qui devrait minimiser l'impact des contraintes de décarbonation sur l'erreur de suivi entre l'Indice et l'Indice parent. Cependant, toute stratégie alignée sur un scénario à 1,5 °C est accompagnée d'un objectif de décarbonation absolu qui doit être atteint pour parvenir à cet alignement à 1,5 °C. Étant donné que le niveau de réduction des émissions requis pour un scénario à 1,5 °C est absolu (comme indiqué par le TEG (le Groupe technique d'experts de l'UE sur la finance durable, 2019)), l'Indice est conçu pour décarboner de 7 % d'une année sur l'autre. La réduction relative de l'empreinte carbone requise, à tout moment, pour atteindre cet objectif, dépendra donc de la décarbonation de l'Indice parent. La réduction de l'empreinte carbone requise serait amplifiée par un manque de décarbonation (ou une empreinte carbone accrue) dans l'Indice parent. Un tel scénario peut nécessiter un niveau croissant de différence de pondération des composantes par rapport à l'Indice parent au fil du temps pour atteindre l'objectif souhaité. Par conséquent, une erreur de suivi historique et contre-vérifiée peut ne pas être totalement indicative d'une erreur de suivi future, réalisée si une telle situation devait devenir particulièrement extrême. Étant donné que la limite supérieure de la différence de pondération des composantes de l'Indice parent n'est pas contrôlée pour éviter que les contraintes de décarbonation ci-dessus deviennent impossibles, l'erreur de suivi futur entre l'Indice et l'Indice parent ne peut jamais être complètement plafonnée.

Risque lié aux données carbone utilisées dans la méthodologie de l'Indice

L'analyse des émissions actuelles et futures de gaz à effet de serre des sociétés repose en partie sur des données, modèles et estimations déclaratives. Dans l'état actuel des données disponibles, toutes les données sur les émissions de gaz à effet de serre ne sont pas disponibles et certaines sont basées sur des modèles (en particulier celles liées à la portée 3 qui inclut toutes les émissions de gaz à effet de serre qui ne sont pas directement liées à la fabrication d'un produit).

Risque lié aux composantes de l'Indice

La méthodologie de l'Indice n'empêche pas l'intégration de titres de sociétés émettrices de gaz à effet de serre.

Risques liés à la durabilité

Pour gérer les Risques en matière de durabilité de ce Compartiment, la Société de Gestion s'appuie sur S&P en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques en matière de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie

désignée pour s'aligner sur les normes minimales des indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris. Une telle intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice. Cependant, aucune garantie ne peut être donnée que les Risques en matière de durabilité seront totalement supprimés et la survenance de ces risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice suivis ou reflétés par le Compartiment. Pour de plus amples informations sur la méthodologie de l'Indice, veuillez consulter le site Internet : www.spindices.com. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni commandité, ni approuvé, ni vendu, ni recommandé par Standard & Poor's ou ses filiales (« **S&P** »). S&P s'abstient de toute déclaration ou ne donne aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, aux actionnaires du Compartiment ou à toute personne du public quant à l'opportunité d'un investissement dans des titres en général ou dans le Compartiment particulier ou quant à la capacité de l'indice S S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return à reproduire le rendement de certains marchés financiers et/ou de segments de ces marchés et/ou de groupes et/ou de catégories d'actifs. Le seul lien entre S&P et Amundi Asset Management consiste en l'octroi de licences sur certaines marques et appellations commerciales ainsi que sur l'indice S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return qui est compilé, composé et calculé par S&P, indépendamment de Amundi Asset Management ou du Compartiment. S&P n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins de Amundi Asset Management ou des actionnaires du Compartiment lorsqu'il compile, compose ou calcule l'Indice S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return. S&P n'est pas responsable et n'a pas été partie à la définition des prix et des montants du Compartiment ou au calendrier d'émission ou de vente des Compartiments ou à la définition ou au calcul de l'équation de conversion des actions des Compartiments en actifs liquides. S&P n'a aucune obligation ou responsabilité en termes d'administration ou de commercialisation du Compartiment.

S&P ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'indice S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return ou de toute donnée incorporée dans celui-ci et ne pourra être tenu pour responsable de toute erreur, omission ou interruption affectant cet indice. S&P s'abstient de toute déclaration ou ne donne aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, quant aux résultats

que Amundi Asset Management, les actionnaires du Compartiment ou toute autre personne ou entité retireront de l'utilisation de l'indice S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return et des données incorporées dans celui-ci. S&P s'abstient de toute déclaration ou ne donne aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, et décline expressément toute garantie, quant à la qualité marchande ou l'adéquation à un usage donné ou une finalité particulière ainsi que tout autre garantie ou condition, explicite ou implicite, concernant l'indice S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return et les données incorporées dans celui-ci. Sans préjudice de ce qui précède, S&P ne pourra être tenu pour responsable d'un quelconque préjudice du fait de dommages et intérêts spéciaux, indirects ou pour préjudice moral, ou de dommages et intérêts indirects (y compris pour un manque à gagner) résultant de l'utilisation de l'indice S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return de toute autre donnée incorporée dans celui-ci, même s'il a été avisé de la possibilité de tels dommages.

ANNEXE 75

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return (l'« **Indice** »), libellé en euros, qui est représentatif de la performance d'actions éligibles de l'indice S&P Europe LargeMidCap (l'« **Indice parent** ») sélectionnées et pondérées de façon à former un univers compatible avec un scénario de réchauffement climatique planétaire de 1,5 °C, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les Catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment utilisera également une stratégie mensuelle de couverture de change afin de minimiser l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE**Objectifs de l'Indice**

L'Indice est basé sur l'Indice parent qui est représentatif des titres de grande et moyenne capitalisation des marchés d'actions européens. L'Indice mesure la performance de titres de participation éligibles de l'Indice parent, sélectionnés et pondérés pour être compatibles collectivement avec un scénario de réchauffement climatique mondial de 1,5 °C. Il intègre un large éventail d'objectifs liés au climat couvrant le risque de transition, les opportunités de changement climatique et le risque physique, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

L'Indice a été conçu pour s'aligner sur les normes minimales telles que proposées dans le Rapport final

du Groupe technique d'experts de l'Union européenne sur les indices de référence climatiques et les divulgations ESG (le « **TEG** ») et est éligible au label Indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris (« **EU PAB** »). Les propositions contenues dans le Rapport final ne sont pas juridiquement contraignantes. Le rapport final servira de base à la Commission européenne pour rédiger des actes délégués visant à mettre en œuvre les exigences du Règlement (UE) 2019/2089.

À la suite de la publication des actes délégués finaux, la méthodologie sera révisée et mise à jour si nécessaire afin de s'aligner sur toute modification pertinente des normes minimales pour les indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris. Si un changement de méthodologie s'avérait nécessaire, les S&P Dow Jones Indices émettraient une annonce avant la mise en œuvre du changement (et, dans ces circonstances, les S&P Dow Jones Indices n'effectueraient pas de consultation formelle).

Méthodologie de l'Indice

La performance suivie est basée sur les cours de clôture de l'Indice.

L'Indice est calculé par les S&P Dow Jones Indices.

La méthodologie complète de l'Indice (y compris sa conservation et son rééquilibrage) est disponible sur le site internet : <https://us.spindices.com/>.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels (en mars, juin, septembre et décembre).

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'Indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

Informations complémentaires sur l'Indice

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <https://us.spindices.com/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels qui souhaitent être exposés aux actions européennes de grande et moyenne capitalisation sélectionnées et pondérées pour être collectivement compatibles avec un scénario de réchauffement climatique mondial de 1,5 °C.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différences modalitiques décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de perte en capital, Risque lié aux actions, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque lié à

l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque de couverture de change de Catégorie, Risque de change, Manque de réactivité face à l'évolution des circonstances, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Manque d'historique d'exploitation, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque lié au calcul de l'Indice.

En outre, le Compartiment est exposé au risque suivant :

Risque de retrait du label EU PAB

L'Indice a été conçu pour être éligible au label « Indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris » (« **EU PAB** »).

Par conséquent, il devrait recevoir le label européen EU PAB associé. Pour que l'Indice satisfasse à la réglementation, l'Indice doit, entre autres contraintes, réduire son intensité carbone à 7 % d'une année sur l'autre, en utilisant des pondérations moyennes tout au long de la période. L'Indice est conçu pour être conforme à chaque rééquilibrage. Cependant, les pondérations des sociétés, leurs émissions de carbone et leur valeur d'entreprise (qui est le dénominateur dans le calcul de l'intensité carbone) peuvent changer entre les rééquilibrages. Pour éviter toute ambiguïté, la réglementation garantit que le rapport d'indice est basé sur les pondérations moyennes entre les rééquilibrages. Par conséquent, même si l'Indice est conforme à chaque rééquilibrage, il peut ne pas nécessairement conserver le label sur la base de rapports utilisant des pondérations moyennes. En outre, dans une situation où un trop grand nombre de sociétés de l'Indice parent augmentent leurs émissions absolues de carbone sur une longue période, l'Indice pourrait ne pas respecter certaines normes minimales des indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris et ainsi perdre son label.

Risque d'optimisations insolubles

La méthodologie de l'Indice utilise une méthodologie d'optimisation. En cas d'optimisation, il n'est pas toujours possible de trouver une solution qui réponde simultanément à toutes les contraintes. Il est prudent de garder à l'esprit que les augmentations de futures réductions relatives de l'empreinte carbone, ou les changements imprévisibles dans les exclusions ou d'autres ensembles de données, peuvent éventuellement provoquer des optimisations insolubles à l'avenir. Pour cette raison, une hiérarchie de relaxation de contraintes a été établie dans la méthodologie de l'Indice afin de minimiser davantage le risque de solutions insolubles.

Risque de consolidation illimitée sur la différence entre les pondérations des composantes de l'Indice parent

La fonction objectif de l'optimisation est de minimiser la différence de pondération des composantes par rapport à l'Indice parent, ce qui devrait minimiser l'impact des contraintes de décarbonation sur l'erreur

de suivi entre l'Indice et l'Indice parent. Cependant, toute stratégie alignée sur un scénario à 1,5 °C est accompagnée d'un objectif de décarbonation absolu qui doit être atteint pour parvenir à cet alignement à 1,5 °C. Étant donné que le niveau de réduction des émissions requis pour un scénario à 1,5 °C est absolu (comme indiqué par le TEG (le Groupe technique d'experts de l'UE sur la finance durable, 2019)), l'Indice est conçu pour décarboner de 7 % d'une année sur l'autre. La réduction relative de l'empreinte carbone requise, à tout moment, pour atteindre cet objectif, dépendra donc de la décarbonation de l'Indice parent. La réduction de l'empreinte carbone requise serait amplifiée par un manque de décarbonation (ou une empreinte carbone accrue) dans l'Indice parent. Un tel scénario peut nécessiter un niveau croissant de différence de pondération des composantes par rapport à l'Indice parent au fil du temps pour atteindre l'objectif souhaité. Par conséquent, une erreur de suivi historique et contre-vérifiée peut ne pas être totalement indicative d'une erreur de suivi future, réalisée si une telle situation devait devenir particulièrement extrême. Étant donné que la limite supérieure de la différence de pondération des composantes de l'Indice parent n'est pas contrôlée pour éviter que les contraintes de décarbonation ci-dessus deviennent impossibles, l'erreur de suivi futur entre l'Indice et l'Indice parent ne peut jamais être complètement plafonnée.

Risque lié aux données carbone utilisées dans la méthodologie de l'Indice

L'analyse des émissions actuelles et futures de gaz à effet de serre des sociétés repose en partie sur des données, modèles et estimations déclaratives. Dans l'état actuel des données disponibles, toutes les données sur les émissions de gaz à effet de serre ne sont pas disponibles et certaines sont basées sur des modèles (en particulier celles liées à la portée 3 qui inclut toutes les émissions de gaz à effet de serre qui ne sont pas directement liées à la fabrication d'un produit).

Risque lié aux composantes de l'Indice

La méthodologie de l'Indice n'empêche pas l'intégration de titres de sociétés émettrices de gaz à effet de serre.

Risques liés à la durabilité

Pour gérer les Risques en matière de durabilité de ce Compartiment, la Société de Gestion s'appuie sur S&P en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques en matière de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie désignée pour s'aligner sur les normes minimales des indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris. Une telle intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice. Cependant, aucune garantie ne peut être donnée que les Risques en matière de durabilité seront totalement supprimés et la survenance de ces risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice suivis ou reflétés par le Compartiment. Pour de plus amples informations sur la méthodologie de l'Indice, veuillez consulter le site Internet : www.spindices.com. De

plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni commandité, ni approuvé, ni vendu, ni recommandé par Standard & Poor's ou ses filiales (« S&P »). S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ni garantie, explicite ou implicite, aux actionnaires du Compartiment ou à tout membre du public concernant les opportunités d'investissement dans des valeurs mobilières en général ou dans un Compartiment particulier ou concernant la capacité du S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index à reproduire le rendement de certains marchés financiers et/ou de parties de ces marchés et/ou groupes ou catégories d'actifs. La seule relation liant S&P à Amundi Asset Management est l'octroi de licences pour certaines marques déposées ou marques commerciales et pour le S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index qui est défini, composé et calculé par S&P, sans considération pour Amundi Asset Management ou pour le Compartiment. S&P n'est pas tenue de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des actionnaires du Compartiment lors de la définition de la composition ou du calcul du S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index. S&P n'est pas responsable et n'a pas été partie à la définition des prix et des montants du Compartiment ou au calendrier d'émission ou de vente des Compartiments ou à la définition ou au calcul de l'équation de conversion des actions des Compartiments en actifs liquides. S&P n'a aucune obligation ou responsabilité en termes d'administration ou de commercialisation du Compartiment.

S&P ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité du S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index ou de toute donnée qu'il contient et décline toute responsabilité en cas d'erreur, d'omission ou d'interruption en découlant. S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ni garantie, explicite ou implicite, concernant les résultats qui seront obtenus par Amundi Asset Management, les actionnaires du Compartiment ou toute autre personne ou entité utilisant le S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index ou toute donnée qu'il contient. S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, et refuse expressément toute garantie, condition de qualité du marché ou aptitude à une fin objective ou spécifique et toute autre garantie ou condition, explicite ou implicite, relative au S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index ou à toute donnée qu'il contient. Sans limiter ce qui précède, S&P ne sera

pas responsable des dommages spéciaux, punitifs, indirects ou consécutifs (y compris la perte de profits) résultant de l'utilisation du S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index ou de toute autre donnée qu'il contient, même si elle a été avertie de la possibilité que ledit dommage puisse survenir.

ANNEXE 76

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Green Bond

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 9 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Euro Government Green Bond** (le « **Compartiment** ») est de refléter la performance du « Solactive Euro Government Green Bond Index » (l'« **Indice de référence** »), libellé en euros, afin d'offrir une exposition au marché des obligations vertes d'États européens, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice de référence (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées dans l'ANNEXE C - SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment aura également recours à une stratégie de couverture de change mensuelle, afin de réduire l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respective par rapport aux devises de chaque composant de l'indice de référence.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE DE RÉFÉRENCE

- **Objectifs de l'Indice de référence**

L'Indice de référence est représentatif de la performance d'Obligations vertes de catégorie investment grade, émises par des pays européens et libellées eu EUR. Les obligations vertes sont émises dans l'objectif de financer des projets ayant un impact environnemental positif, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice de référence**

L'indice de référence est basé, notamment, sur les prix fournis par Solactive et des sources de prix tierces.

L'Indice de référence est calculé quotidiennement.

L'Indice de référence est compilé, administré et géré par Markit.

La composition de l'Indice de référence est révisée et rééquilibrée le dernier jour ouvrable du mois.

La fréquence des rééquilibrages telle que décrite ci-dessus aura une incidence sur les coûts au cours de la réalisation de l'objectif d'investissement. Ce rééquilibrage de l'Indice de référence peut notamment engendrer des coûts de transaction supplémentaires.

L'Indice de Référence est un indice de type « Total Return » (c'est-à-dire que tous les coupons détachés par les composants de l'Indice de Référence sont réinvestis dans l'Indice de Référence)

La méthode de construction de l'Indice de référence (y compris les règles régissant le suivi et le rééquilibrage de l'Indice de référence et ses effets sur les coûts de la stratégie) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <https://www.solactive.com>.

- **Informations supplémentaires sur l'Indice de référence**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice de référence, sa composition, son mode de calcul, ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles à l'adresse <https://www.solactive.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice de référence, veuillez vous référer au paragraphe B « Investissements effectués par des compartiments indiciels » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions en matière d'investissement » de la partie principale du présent Prospectus et à l'ANNEXE F - REGLEMENT RELATIF AUX INDICES DE RÉFÉRENCE

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur. Les investisseurs de ce Compartiment recherchent une exposition à la performance des obligations vertes investment grade émises par des pays européens et libellées en euros.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 2 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque en capital, Risque de faible diversification, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié au calcul de l'Indice.

LIMITES DE L'APPROCHE EXTRA-FINANCIÈRE

L'approche extra-financière mise en œuvre par le Compartiment repose en grande partie sur des données de tiers qui peuvent être parfois incomplètes, inexactes ou indisponibles. La Société de gestion est donc dépendante de la qualité et de la fiabilité de ces informations. Enfin, les investissements dans les obligations vertes peuvent induire des biais sectoriels sur le marché obligataire mondial.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur Solactive en tant qu'administrateur de l'Indice de référence, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans la méthodologie de l'Indice de référence. Cette intégration a donc un impact direct sur l'Univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice de référence suivi ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations sur la méthodologie de l'Indice de référence, veuillez vous référer à : <https://www.solactive.com>. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est pas parrainé, promu, vendu ou favorisé par Solactive AG et Solactive AG ne donne aucune garantie ou assurance quant aux résultats de l'utilisation de l'Indice de référence et/ou de la marque de l'Indice de référence ou du prix de l'Indice de référence à tout moment ou à tout autre égard. L'Indice de référence est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait tout ce qui est en son pouvoir pour que l'Indice de référence soit calculé

correctement. Indépendamment de ses obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'a aucune obligation de signaler les erreurs de l'Indice de Référence à des tiers, y compris, mais sans s'y limiter, aux investisseurs et/ou aux intermédiaires financiers du Compartiment. Ni la publication de l'Indice de référence par Solactive AG, ni l'octroi d'une licence portant sur l'Indice de référence ou sa marque en vue de son utilisation aux fins du Compartiment n'a valeur de recommandation d'un investissement dans le Compartiment par Solactive AG, et ils n'impliquent en aucune manière une garantie ou un avis de Solactive AG concernant tout investissement dans le Compartiment.

ANNEXE 77

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Corporate Green Bond

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Corporate Green Bond** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution à la hausse comme à la baisse de l'indice « Solactive EUR USD IG Corporate Green Bond TR Index » (l'« **Indice** »), libellé en euros, afin d'offrir une exposition aux obligations vertes en EUR et en USD émises par des entreprises et notées investment grade, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Pour les catégories d'actions Monthly Hedged mentionnées dans l'ANNEXE C - SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS, le Compartiment aura également recours à une stratégie de couverture de change mensuelle, afin de réduire l'impact de l'évolution de la devise de chaque catégorie d'actions respectives par rapport aux devises de chaque composante de l'Indice.

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 0,50 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance des obligations vertes investment grade émises par des entreprises européennes et libellées en EUR et en USD. Les obligations vertes sont émises dans l'objectif de financer des projets ayant un impact environnemental positif, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'indice est basé, notamment, sur les prix fournis par Solactive et des sources de prix tierces.

L'Indice est calculé quotidiennement.

L'Indice est compilé, administré et géré par Solactive.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage le dernier jour ouvrable du mois.

La fréquence des rééquilibrages telle que décrite ci-dessus aura une incidence sur les coûts au cours de la réalisation de l'objectif d'investissement. Les frais particuliers générés par ces rééquilibrages de l'Indice incluent les coûts de transaction supplémentaires.

L'Indice est un indice de type « Total Return » (c'est-à-dire que tous les coupons détachés par les composantes de l'Indice sont réinvestis dans ce dernier)

La méthode de construction de l'Indice (y compris les règles régissant le suivi et le rééquilibrage de l'Indice et ses effets sur le coût de la stratégie) est décrite de manière exhaustive sur le site Internet : <https://www.solactive.com>.

- **Informations supplémentaires sur l'Indice**

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <https://www.solactive.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit

du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est ouvert à tout souscripteur. Les investisseurs de ce Compartiment recherchent une exposition à la performance des obligations vertes investment grade émises par des Entreprises et libellées en EUR euros.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur

boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 2 % de la Valeur liquidative par Action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque de taux d'intérêt, Risque de crédit, Risque en capital, Risque de faible diversification, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de liquidité du Compartiment (Marché primaire), Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de marché lié à une controverse, Risque d'érosion du capital, Manque de réactivité aux changements de circonstance, Absence d'historique, Risque lié aux investissements dans les pays émergents et en voie de développement, Risque de couverture de change de la Catégorie, Risque de perturbation de l'indice, Risque opérationnel, Risque d'opération sur titres, Risque lié au calcul de l'Indice.

LIMITES DE L'APPROCHE EXTRA-FINANCIÈRE

L'approche extra-financière mise en œuvre par le Compartiment repose en grande partie sur des données de tiers qui peuvent être parfois incomplètes, inexactes ou indisponibles. La Société de gestion est donc dépendante de la qualité et de la fiabilité de ces informations. Enfin, les investissements dans les obligations vertes peuvent induire des biais sectoriels sur le marché obligataire mondial.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur Solactive en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans la méthodologie de l'Indice. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations sur la méthodologie de l'Indice, veuillez vous référer à : <https://www.solactive.com>. De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni parrainé, promu, vendu ou soutenu de quelque autre manière par Solactive AG. De même, Solactive AG ne donne à aucun moment une quelconque garantie ou assurance, expresse ou tacite, quant aux résultats obtenus en utilisant l'Indice et/ou la marque de l'Indice ou son cours, ou à tout autre égard. L'Indice est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait tout ce qui est en son pouvoir pour que l'Indice soit calculé correctement. Indépendamment de ses obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'a aucune obligation de signaler les erreurs de l'Indice à des tiers, y compris, mais sans s'y limiter, aux investisseurs et/ou aux intermédiaires financiers du Compartiment. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG, ni l'octroi d'une licence portant sur l'Indice ou sa marque en vue de son utilisation aux fins du Compartiment n'a valeur de recommandation d'un investissement dans le Compartiment par Solactive AG, et ils n'impliquent en aucune manière une garantie ou un avis de Solactive AG à l'égard de tout investissement dans le Compartiment.

ANNEXE 78

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Markets II

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement du **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Emerging Markets II** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution à la hausse comme à la baisse de l'indice MSCI Emerging Markets Net Total Return Index (l'« **Indice** »), libellé en dollars des États-Unis (USD), et représentatif de la performance des sociétés de grande et moyenne capitalisation sur les marchés émergents, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE

- Objectifs de l'Indice

L'Indice est un indice de capitalisation boursière ajustée au flottant conçu pour mesurer la performance des segments de grande et de moyenne capitalisation des marchés émergents.

L'objectif de l'Indice est de représenter 85 % de la capitalisation boursière ajustée au flottant de chaque groupe de secteurs sur les marchés émergents.

En ciblant une représentation de 85 % pour chaque groupe de secteurs, l'Indice vise à refléter 85 % de la capitalisation boursière totale des marchés émergents, tout en reflétant la diversité économique de ces marchés.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

- Méthodologie de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices mondial MSCI.

L'Indice est exclusivement composé d'actions des marchés émergents et présente les mêmes caractéristiques de base que les indices MSCI, qui comprennent l'ajustement de la capitalisation boursière des actions de l'Indice sur la base de leur flottant et de leur classification par secteur en utilisant la Norme mondiale de classification des secteurs (GICS).

L'Indice est composé uniquement d'actions des marchés émergents et comprend des sociétés de grande et moyenne capitalisation dans un certain nombre de pays des marchés émergents du monde entier.

La méthodologie MSCI et la méthode de calcul sont basées sur un nombre variable de sociétés de l'Indice.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.msci.com.

La composition de l'Indice est révisée et rééquilibrée tous les 6 mois (en mai et novembre) avec des révisions trimestrielles en février, mai, août et novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

- Informations complémentaires sur l'Indice

Des renseignements supplémentaires sur l'Indice, sa composition, son mode de calcul et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques ainsi que sur la méthodologie générale présidant à sa conception sont disponibles sur le site Internet <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans des OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (InvStG-E) (« GITA »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié tant aux investisseurs particuliers qu'aux investisseurs institutionnels qui souhaitent être exposés à la performance de sociétés de grande et moyenne capitalisation des pays des marchés émergents.

CATÉGORIES D'ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

GESTION DES RISQUES

L'exposition globale de ce Compartiment est calculée en utilisant l'approche par les engagements telle que détaillée dans les lois et réglementations applicables, y compris, mais sans s'y limiter, la Circulaire CSSF 11/512.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur

boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur <http://www.amundiETF.com>.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Actions, Risques liés à l'investissement dans des marchés émergents et développés, Risques liés à l'investissement dans des actions de moyenne capitalisation, Capital à risque, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque de gestion des garanties, Risque de change.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. Ce Compartiment est considérablement exposé aux régions qui peuvent avoir une surveillance gouvernementale ou réglementaire relativement faible ou une transparence ou une divulgation moindre des Facteurs de durabilité et peut donc être soumis à des Risques accrus en matière de durabilité. De plus amples informations sont disponibles à la section du Prospectus intitulée « PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ ».

RÈGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'article 7 du Règlement Taxinomie, la Société de Gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est en aucun cas commandité, avalisé, vendu ou promu par MSCI Inc. (« **MSCI** »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par la Société de gestion. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec la Société de gestion ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins de la Société de gestion ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune

autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 79

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Europe Climate Action

Le Compartiment est un compartiment indiciel de type UCITS à gestion passive.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Europe Climate Action** (le « **Compartiment** ») consiste à suivre l'évolution tant à la hausse qu'à la baisse du MSCI Europe Climate Action Net Total Return Index (l'« **Indice** »), libellé en EUR, et représentatif de la performance des sociétés de grande et moyenne capitalisation des pays européens développés qui ont été évaluées comme des chefs de file de leur secteur en termes de positionnement et d'actions relatifs à la transition climatique, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Erreur de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE**Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance des sociétés de grande et moyenne capitalisation des pays européens développés qui ont été évaluées comme des chefs de file de leur secteur en termes de positionnement et d'actions relatifs à la transition climatique, comme décrit plus en détail en Annexe I - Publication d'informations ESG de ce Prospectus.

Méthodologie de l'Indice

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI.

La méthodologie complète de l'Indice (y compris sa conservation et son rééquilibrage) est disponible sur le site Internet : <http://www.msci.com>.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage mensuels.

La fréquence des rééquilibrages, telle que décrite ci-dessus, n'aura aucune incidence sur les coûts en ce qui concerne la réalisation de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net calcule la performance des composantes de l'Indice sur la base du fait que les dividendes ou distributions éventuels sont inclus dans les rendements de l'indice après retenue à la source.

Informations complémentaires sur l'Indice

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (InvStG-E) (« GITA »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels à la recherche d'une exposition aux sociétés des marchés d'actions développés d'Europe qui ont été évaluées comme des chefs de file de leur secteur en termes de positionnement et d'actions relatifs à la transition climatique.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risques liés à l'investissement dans des Actions de moyenne capitalisation, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de perte de capital, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le Marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque de contrepartie, Risque lié à la gestion des garanties, Risque de change, Risque de couverture de change de la catégorie, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'indice.

Le Compartiment sera également exposé au risque suivant :

Risque lié aux données carbone utilisées dans la méthodologie de l'Indice

L'analyse des émissions actuelles et futures de gaz à effet de serre des sociétés repose en partie sur des données, modèles et estimations déclaratives. Dans l'état actuel des données disponibles, toutes les données sur les émissions de gaz à effet de serre ne sont pas disponibles et certaines sont basées sur des modèles (en particulier celles liées à la portée 3 qui inclut toutes les émissions de gaz à effet de serre qui ne sont pas directement liées à la fabrication d'un produit).

Risque lié aux composantes de l'Indice

La méthodologie de l'Indice n'empêche pas l'intégration de titres de sociétés émettrices de gaz à effet de serre.

Risques liés à la durabilité

Pour gérer les Risques en matière de durabilité de ce Compartiment, la Société de Gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui

identifie et intègre les Risques en matière de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie désignée pour s'aligner sur les normes minimales des indices de référence européens alignés sur l'Accord de Paris. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations sur la méthodologie de notation MSCI ESG et l'Indice, veuillez vous référer à : <http://www.msci.com>. De plus amples informations sont disponibles dans la section « DIVULGATIONS RELATIVES AUX QUESTIONS DE DURABILITÉ » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI, n'est tenu de prendre en considération les besoins d'Amundi Asset Management ou des détenteurs de parts du Compartiment pour déterminer, composer ou calculer les indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI ne prend aucune décision concernant la date de lancement, le prix et la quantité de parts du Compartiment, ou encore la détermination et le calcul de la formule permettant d'établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI, n'endosse aucune responsabilité ni obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 80

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Basic Resources

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Basic Resources** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Basic Resources Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du super secteur des ressources de base, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au super secteur des ressources de base, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant. L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus

n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du super secteur des ressources de base.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants : Risque lié aux actions, Risque de perte en capital,

Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Basic Resources Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
- ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
- ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,
- composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune

obligation de le faire.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;

- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;

- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;

- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 81

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Banks

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Banks** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Banks Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du super secteur des banques, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au super secteur des banques, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le

contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du super secteur des banques.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus

particulièrement exposé aux risques suivants : Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Banks Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global. STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
- ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
- ne tiennent pas compte des besoins du

Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,

- composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;

- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;

- La qualité marchande et l'adéquation à un usage

particulier de l'Indice et de ses données ;

- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 82

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Consumer Discretionary

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Consumer Discretionary** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Industry Consumer Discretionary 30-15 Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur des biens de consommation discrétionnaires, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au secteur des biens de consommation discrétionnaires, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus

n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du secteur des biens de consommation discrétionnaires.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Industry Consumer Discretionary 30-15 Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
- ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
- ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour

déterminer,

- composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;

- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;

- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;

- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 83

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Industrials

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Industrials** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Industry Industrials 30-15 Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur de l'industrie, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au secteur des valeurs industrielles, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un

indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du secteur industriel.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants : Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX® Europe 600 Industry Industrials 30-15 Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
- ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
- ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,
- composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances. STOXX n'entretient aucune relation contractuelle

avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;
- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;
- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;
- Les performances du Compartiment. De manière générale,

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune

garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 84

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Insurance

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Insurance** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Insurance Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du super secteur des assurances, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au super secteur des assurances, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés

aux sociétés européennes du super secteur des assurances.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants : Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque

d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Insurance Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
 - ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
 - ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,
 - composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.
- STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs

concedants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concedants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;
- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;
- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;
- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs

concedants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concedants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concedants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 85

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Healthcare

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Healthcare** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Health Care Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur des soins de santé, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au secteur des soins de santé, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux grandes sociétés européennes du secteur des soins de santé.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants : Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

Règlement Taxinomie

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Health Care Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
 - ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
 - ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,
 - composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.
- STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances. STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre

partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;
- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;
- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;
- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute

erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 86

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Telecommunications

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Telecommunications** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Telecommunications Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur des télécommunications, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au secteur des télécommunications, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du secteur des télécommunications.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants : Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Telecommunications Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
 - ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
 - ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,
 - composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.
- STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances. STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre

partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;
- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;
- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;
- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute

erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 87

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Utilities

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Utilities** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Utilities Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur des services publics, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au secteur des services publics, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés

aux sociétés européennes du secteur des services publics.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque

d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

Règlement Taxinomie

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Utilities Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global. STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
 - ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
 - ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,
 - composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.
- STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et

ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;
- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;
- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;
- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou

fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 88

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened** est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, du STOXX Europe 600 Energy ESG+ Index (l'« **Indice** »), libellé en euros et représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur de l'énergie, après application d'un ensemble de filtres liés à la conformité, à l'engagement et à la performance ESG, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance de sociétés européennes sélectionnées dans le STOXX Europe 600 Index (qui fournit une exposition à la performance des 600 actions de grande, moyenne et petite capitalisation les plus liquides couvrant les marchés développés d'Europe) qui appartiennent au secteur de l'énergie selon l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** ») (l'« **Univers éligible** ») après application d'un ensemble de filtres liés à la conformité, à la implication et à la performance ESG, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du secteur de l'énergie qui répondent à certaines caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le

nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants : Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque d'opération sur titres, Risque d'érosion du capital, Risques liés à l'investissement dans des actions de moyenne capitalisation, Risques liés au prêt de titres, Risque de gestion des garanties, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur Stoxx en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans le filtrage normatif ISS-ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez consulter :

https://www.stoxx.com/document/Indices/Common/ndexguide/stoxx_index_guide.pdf et [Norm-Based-Research-Methodology.pdf](https://www.stoxx.com/document/Indices/Common/ndexguide/stoxx_index_guide.pdf) (issgovernance.com).

De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Energy ESG+ Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
 - ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
 - n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
 - ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,
 - composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.
- STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;
- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;
- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;
- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 89

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Consumer Staples

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Consumer Staples** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Industry Consumer Staples 30-15 Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur des biens de consommation de base, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au secteur des biens de consommation de base, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le

contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du secteur des valeurs de consommation de base.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Industry Consumer Staples 30-15 Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
- ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
- ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour

déterminer,

- composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;

- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;

- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;

- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 90

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Basic Materials

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Basic Materials** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Industry Basic Materials 30-15 Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur des matériaux de base, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au secteur des matériaux de base, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le

contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplication indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du secteur des matériaux de base.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Industry Basic Materials 30-15 Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
- ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
- ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour

déterminer,

- composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune obligation de le faire.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;

- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;

- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;

- Les performances du Fonds. De manière générale, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 91

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Technology

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi STOXX Europe 600 Technology** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice STOXX Europe 600 Technology Index (l'« **Indice** »), libellé en euros, représentatif de la performance des sociétés européennes du secteur de la technologie, tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE

- **Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière conçu pour représenter la performance de titres du STOXX Europe 600 Index (l'« **Univers initial** ») appartenant au secteur de la technologie, tel que défini par l'Industry Classification Benchmark (« **ICB** »). L'Univers initial fournit une exposition à la performance des 600 valeurs à petite, moyenne et grande capitalisation les plus liquides issues des marchés développés européens.

- **Méthodologie de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant.

L'Indice est publié en temps réel par Reuters et Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice à l'adresse www.qontigo.com.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels en mars, en juin, en septembre et en décembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site Internet du fournisseur de l'Indice : <http://www.qontigo.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification indirecte, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera

effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés européennes du secteur de la technologie.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants : Risque lié aux actions, Risque de perte en capital,

Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque de gestion des garanties, Risque du calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

STOXX Ltd., le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'ont aucune relation avec Amundi Asset Management (le « Titulaire de la licence »), à l'exception de la licence accordée par le Titulaire de la licence à STOXX Europe 600 Technology Index (l'« Indice ») et aux marques commerciales associées. Les indices iSTOXX sont adaptés à une demande du client ou à une exigence du marché sur la base d'un corpus réglementaire individualisé qui n'est pas intégré à la famille d'indices STOXX Global.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données :

- ne sponsorisent, n'approuvent, ne vendent ou ne promeuvent pas le Titulaire de licence en vue de l'insertion de la désignation du produit.
- ne recommandent pas à quiconque d'investir dans le Compartiment ou dans d'autres titres.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation ni ne prennent aucune décision quant à l'établissement du calendrier, la détermination des volumes ou la fixation des prix du Compartiment.
- n'ont aucune responsabilité ou obligation quant à l'administration, la gestion et la commercialisation du Compartiment.
- ne tiennent pas compte des besoins du Compartiment ou de ses propriétaires pour déterminer,
- composer ou calculer l'Indice, ni n'ont aucune

obligation de le faire.

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données n'offrent aucune garantie et ne peuvent être tenus responsables (que ce soit pour cause de négligence ou pour toute autre raison) à l'égard du Compartiment ou de ses performances.

STOXX n'entretient aucune relation contractuelle avec les acheteurs du Compartiment ou toute autre partie tierce.

Plus particulièrement, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie, expresse ou implicite, et déclinent toute responsabilité concernant :

- Les résultats à obtenir par le Compartiment, le propriétaire du Compartiment ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'Indice et des données incluses dans l'Indice ;
- L'exactitude, l'actualité et l'exhaustivité de l'Indice et de ses données ;
- La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'Indice et de ses données ;
- Les performances du Fonds. De manière générale,

STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants de licence, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne donnent aucune garantie et déclinent toute responsabilité pour toute erreur, omission ou interruption au niveau de l'Indice ou de ses données ;

En aucun cas, STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ne pourront être tenus responsables (en cas de négligence ou autre) de quelque manque à gagner que ce soit ou tout dommage ou perte indirecte, à caractère punitif, spécifique ou faisant suite à de telles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice ou de ses données ou plus généralement en lien avec le Compartiment, même si STOXX, le Groupe Deutsche Börse et leurs concédants, partenaires de recherche ou fournisseurs de données ont été avertis de l'existence de tels risques de pertes ou de dommages. Le Contrat de Licence entre le Titulaire de licence et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs des Compartiment ou toute autre partie tierce.

ANNEXE 92

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI EMU Value Factor

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

La Devise de référence du Compartiment est l'euro (EUR).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI EMU Value Factor** (le « **Compartiment** ») est de répliquer l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice MSCI EMU Value (l'« **Indice** ») libellé en euros, représentatif de la performance de titres de grande et moyenne capitalisations présentant des caractéristiques stylistiques générales de valeur dans les pays développés de l'Union économique et monétaire européenne (« **UEM** »), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE**Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions représentatif des titres de grande et moyenne capitalisations présentant des caractéristiques stylistiques générales de valeur dans les pays développés de l'UEM.

Méthodologie de l'Indice

L'Indice est basé sur l'Indice MSCI EMU, qui capture la représentation des grandes et moyennes capitalisations des dix pays de marchés développés de l'UEM, couvrant environ 85 % de la capitalisation boursière ajustée au flottant du marché sous-jacent.

L'Indice comprend des actions de sociétés qui sont sous-évaluées par le marché par rapport à la valeur de leurs actifs et à la croissance de leurs bénéfices. Les caractéristiques stylistique d'investissement dans la valeur pour la construction de l'indice sont définies à l'aide de trois variables : valeur comptable par rapport au prix, bénéfices à venir sur 12 mois par rapport au prix et rendement du dividende.

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI. Comme décrit dans la méthodologie de l'Indice, chaque titre de l'Indice reçoit une note de valeur. Chaque valeur de l'Indice est ajustée en fonction de la capitalisation boursière corrigée du flottant et de sa note de valeur. L'Indice est publié en temps réel par Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site Internet du fournisseur d'indices à l'adresse <https://www.msci.com/constituents>.

La composition de l'Indice est repondérée tous les 6

mois avec un ajustement trimestriel (en février, mai, août et novembre).

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site web du fournisseur de l'Indice : <https://www.msci.com/>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement ne sera effectué dans d'autres OPC.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Ce Compartiment est éligible aux plans d'épargne en actions français (PEA) ; ce qui signifie qu'il investit au moins 75 % de ses actifs dans un portefeuille diversifié d'actions émises par un émetteur constitué dans un État membre de l'Union européenne ou de l'Espace Économique Européen.

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« **InvStG-E** »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est dédié aux investisseurs de détail et institutionnels à la recherche d'une exposition à des titres de grande et moyenne capitalisations présentant des caractéristiques stylistiques générales de valeur dans les pays développés de l'Union économique et monétaire européenne.

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET

FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de couverture de change, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de contrepartie, Risque de prêt de titres, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risques liés à l'investissement dans des actions de moyenne capitalisation, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Ce Compartiment ne promeut pas les caractéristiques ESG et n'optimise pas l'alignement du portefeuille sur les Facteurs de durabilité. Cependant, il reste exposé aux Risques de durabilité et la réalisation de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des investissements réalisés par le Compartiment. De plus amples informations se trouvent dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

REGLEMENT TAXINOMIE

Conformément à l'Articles 7 du Règlement Taxinomie, la Société de gestion attire l'attention des investisseurs sur le fait que les investissements sous-jacents à ce Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir

compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 93

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Gender Equality

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi Global Gender Equality** (le « **Compartiment** ») est de suivre l'évolution à la hausse comme à la baisse de l'indice Solactive Equileap Global Gender Equality (l'« **Indice** »), libellé en dollar des États-Unis (USD), des performances des grandes entreprises mondiales dans le domaine de l'égalité entre les genres et dont les composantes répondent à des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (« **ESG** »), tout en minimisant la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 1 %.

L'INDICE**Objectifs de l'Indice**

L'Indice est un indice d'actions qui offre une exposition aux sociétés leaders mondiales dans le domaine de l'égalité entre les genres, sélectionnées à l'aide d'un filtre sur l'égalité entre les genres appliqué par le fournisseur de données Equileap, et dont les composantes répondent à des exigences ESG.

Les exigences ESG et les filtres relatifs à l'égalité entre les genres sont décrits plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

Méthodologie de l'Indice

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux Solactive.

L'Indice est publié en temps réel par Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site web du fournisseur d'indices à l'adresse www.solactive.com.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

La composition de l'Indice fait l'objet d'une sélection annuelle et d'une révision et d'un rééquilibrage trimestriels.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement. L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

Informations complémentaires sur l'Indice

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site web du fournisseur de l'Indice : <https://www.solactive.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplique directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et

TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés aux sociétés leadeuses mondiales dans le domaine de l'égalité entre les genres et qui répondent à certaines caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie

principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Capital à risque, Risque de change, Risque de contrepartie, Risque de faible diversification, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque sur les investissements dans les marchés émergents et en développement, Risque de couverture de change, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de prêt de titres, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risques liés à l'investissement dans des actions de moyenne capitalisation, Risque lié au calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur Solactive en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations sur la méthodologie de Solactive, veuillez vous référer à : <http://www.solactive.com>.

De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni parrainé, promu, vendu ou soutenu de quelque autre manière par Solactive AG. De même, Solactive AG ne donne à aucun moment une quelconque garantie ou assurance, expresse ou tacite, quant aux résultats obtenus en utilisant l'Indice et/ou la marque de l'Indice ou son cours, ou à tout

autre égard. L'Indice est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait tout ce qui est en son pouvoir pour que l'Indice soit calculé correctement. Indépendamment de ses obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'a aucune obligation de signaler les erreurs de l'Indice à des tiers, y compris, mais sans s'y limiter, aux investisseurs et/ou aux intermédiaires financiers du Compartiment. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG, ni l'octroi d'une licence portant sur l'Indice ou sa marque en vue de son utilisation aux fins du Compartiment n'a valeur de recommandation d'un investissement dans le Compartiment par Solactive AG, et ils n'impliquent en aucune manière une garantie ou un avis de Solactive AG à l'égard de tout investissement dans le Compartiment.

APPENDIX 94

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened** (le « **Compartiment** ») est de suivre à la fois l'évolution à la hausse et à la baisse de l'Indice MSCI ACWI IMI Digital Economy & Metaverse ESG Filtered Index (l'« **Indice** ») libellé en dollars américains et représentatif d'un ensemble de sociétés sélectionnées dans l'Indice MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (l'« **Indice parent** ») et qui devraient tirer des revenus importants de la chaîne de valeur de l'économie numérique, y compris de l'écosystème du métaverse, qui exclut les sociétés avec des lacunes sur le plan environnemental, social et de la gouvernance (ESG) par rapport à l'univers du thème, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

L'écart de suivi prévu dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE**Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance de sociétés sélectionnées dans l'Indice parent (qui fournit une exposition aux actions de grande, moyenne et petite capitalisations de pays développés et émergents) qui devraient tirer des revenus significatifs de la chaîne de valeur de l'économie numérique, notamment : de l'écosystème du métaverse (paiements numériques, e-commerce, réseaux sociaux, blockchain, intelligence artificielle), de la cybersécurité, du cloud computing, des robots et de l'automatisation, et de l'économie du partage. L'Indice exclut les sociétés qui sont à la traîne en matière de critères ESG par rapport à l'univers thématique, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

Méthodologie de l'Indice

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI.

L'Indice est publié en temps réel par Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des

composantes de l'Indice sont disponibles sur le site web du fournisseur d'indices à l'adresse <https://www.msci.com>.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

L'Indice est révisé et rééquilibré semestriellement, en mai et en novembre, pour coïncider avec les révisions de l'Indice parent de mai et de novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site web du fournisseur de l'Indice : <https://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques

environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés à des sociétés de pays développés et émergents qui dérivent des revenus importants de la chaîne de valeur de l'économie numérique et présentent des caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) :

1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque lié à l'investissement dans des sociétés de petite et moyenne capitalisations, Risque lié à l'investissement dans des actions de moyenne capitalisation, Risque de faible diversification, Capital à risque, Risque de contrepartie, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risques liés au prêt de titres, Risque lié aux investissements dans les marchés émergents et en développement, Risque de change, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de perturbation de l'indice, Risque opérationnel, Risque d'action d'entreprise, Risque d'érosion du capital, Risques spécifiques liés aux GDR et ADR, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG de MSCI, veuillez consulter : <http://www.msci.com>.

De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI réfuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 95

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened** (le « **Compartiment** ») est de suivre à la fois l'évolution à la hausse et à la baisse de l'indice MSCI ACWI IMI Disruptive Technology ESG Filtered Index (l'« **Indice** ») libellé en dollars américains (USD) et représentatif d'un ensemble de sociétés sélectionnées dans l'indice MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (l'« **Indice parent** ») alignées sur des thèmes généralement associés avec la « technologie disruptive » ou décrits comme telle, après exclusion des sociétés avec des lacunes sur le plan environnemental, social et de la gouvernance (« **ESG** ») par rapport à l'univers du thème, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Le niveau prévu de l'Erreur de suivi dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE**Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance de sociétés sélectionnées dans l'Indice parent (qui fournit une exposition aux actions de grande, moyenne et petite capitalisations de pays développés et émergents) alignées sur des thèmes généralement associés à la « technologie disruptive » comme : l'impression 3D, l'Internet des objets (IoT), le cloud computing, la fintech, les paiements numériques, l'innovation en santé, la robotique, la cybersécurité ou l'énergie propre et les smart grids. L'Indice exclut les sociétés qui sont à la traîne en matière de critères ESG par rapport à ses univers thématiques, comme décrits plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

Méthodologie de l'Indice

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI.

L'Indice est publié en temps réel par Bloomberg. Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site

web du fournisseur d'indices à l'adresse <https://www.msci.com>.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

L'Indice est révisé et rééquilibré semestriellement, en mai et en novembre, pour coïncider avec les révisions de l'Indice parent de mai et de novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site web du fournisseur de l'Indice : <https://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÉGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à

l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés à des sociétés de pays développés et émergents alignés sur des thèmes généralement associés à la technologie disruptive ou décrit comme tels, avec des caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le

nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque lié à l'investissement dans les marchés émergent set en développement, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de perturbation de l'Indice, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque opérationnel, Risque d'opération de société, Risque d'érosion du capital, Risques liés à l'investissement dans des actions de petite et moyenne capitalisations, Risques liés au prêt de titres, Risque de gestion des garanties, Risques particuliers liés aux GDR et aux ADR, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG de MSCI, veuillez consulter : <http://www.msci.com>.

De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde

une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 96

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Future Mobility ESG Screened

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Future Mobility ESG Screened** (le « **Compartiment** ») est de suivre à la fois l'évolution à la hausse et à la baisse de l'indice MSCI ACWI IMI Future Mobility ESG Filtered Index (l'« **Indice** ») libellé en dollars américains (USD) et représentatif d'un ensemble de sociétés sélectionnées dans l'indice MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (l'« **Indice parent** ») et qui devraient tirer des revenus importants des technologies de stockage de l'énergie, des véhicules autonomes, de la mobilité partagée et des nouvelles méthodes de transport, après exclusion des sociétés avec des lacunes sur le plan environnemental, social et de la gouvernance (« **ESG** ») par rapport à l'univers du thème, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Le niveau prévu de l'Erreur de suivi dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE**Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance de sociétés sélectionnées dans l'Indice parent (qui fournit une exposition aux actions de grande, moyenne et petite capitalisations de pays développés et émergents) associées au développement de nouveaux produits et services centrés sur les technologies de stockage de l'énergie, les véhicules autonomes, la mobilité partagée et les nouvelles méthodes de transport.

L'Indice sélectionne des sociétés dont l'analyse révèle une forte exposition à des activités telles que :

- les technologies de stockage électrochimique de l'énergie,
- les sociétés minières qui produisent des métaux utilisés pour fabriquer des batteries (véhicules autonomes et technologies connexes, véhicules électriques (« **VE** »), composants et matériaux des VE, nouvelles méthodes de transport, passagers et fret, y compris les véhicules électriques, les véhicules autonomes, la mobilité partagée (économie de partage)).

L'Indice exclut les sociétés qui sont à la traîne en matière de critères ESG par rapport à l'univers thématique, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

Méthodologie de l'Indice

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI.

L'Indice est publié en temps réel par Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site web du fournisseur d'indices à l'adresse <https://www.msci.com>.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

L'Indice est révisé et rééquilibré semestriellement, en mai et en novembre, pour coïncider avec les révisions de l'Indice parent de mai et de novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

- **Informations complémentaires sur l'Indice**

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site web du fournisseur de l'Indice : <https://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les

droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veuillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés à des sociétés de pays développés et émergents qui devraient dériver des revenus importants des technologies de stockage de l'énergie, des véhicules autonomes, de la mobilité partagée et des nouvelles méthodes de transport, et qui présentent des caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées

tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque lié à l'investissement dans les marchés émergents et en développement, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de perturbation de l'Indice, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque opérationnel, Risque d'opération de société, Risque d'érosion du capital, Risques liés à l'investissement dans des actions de petite et moyenne capitalisations, Risques liés au prêt de titres, Risque de gestion des garanties, Risques particuliers liés aux GDR et aux ADR, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait

avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG de MSCI, veuillez consulter : <http://www.msci.com>.

De plus amples informations sont disponibles dans la section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veuillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite,

quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE 97

MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Millennials ESG Screened

Le Compartiment est un OPCVM indiciel géré passivement.

Ce Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du SFDR comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

La Devise de référence du Compartiment est le dollar américain (USD).

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement de **MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Millennials ESG Screened** (le « **Compartiment** ») est de suivre à la fois l'évolution à la hausse et à la baisse de l'indice MSCI ACWI IMI Millennials ESG Filtered Index (l'« **Indice** ») libellé en dollars américains (USD) et représentatif d'un ensemble de sociétés sélectionnées dans l'indice MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (l'« **Indice parent** ») qui devraient tirer des revenus importants des secteurs qui ciblent les préférences des « millenials », après exclusion des sociétés avec des lacunes sur le plan environnemental, social et de la gouvernance (« **ESG** ») par rapport à l'univers du thème, tout en minimisant la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et le rendement de l'Indice (l'« **Écart de suivi** »).

Le niveau prévu de l'Erreur de suivi dans des conditions de marché normales devrait atteindre 2 %.

L'INDICE**Objectifs de l'Indice**

L'Indice est représentatif de la performance de sociétés sélectionnées dans l'Indice parent (qui fournit une exposition aux actions de grande, moyenne et petite capitalisations de pays développés et émergents) qui devraient tirer des revenus importants de secteurs qui ciblent les préférences des « millenials », avec une forte exposition à des activités comme : les marques populaires, la santé et le fitness, les voyages et loisirs, les réseaux sociaux et le divertissement, l'immobilier et les biens pour la maison, les services financiers, l'alimentation et la restauration, les vêtements et accessoires. L'Indice exclut les sociétés qui sont à la traîne en matière de critères ESG par rapport à l'univers thématique, comme décrit plus en détail à l'Annexe I – Publications d'informations ESG du présent Prospectus.

Méthodologie de l'Indice

L'indice est un indice d'actions calculé et publié par le concepteur d'indices internationaux MSCI.

L'Indice est publié en temps réel par Bloomberg.

Une description complète de l'Indice, de sa méthodologie de construction et des informations sur la composition et les pondérations respectives des composantes de l'Indice sont disponibles sur le site web du fournisseur d'indices à l'adresse <https://www.msci.com>.

La performance reproduite est mesurée par le cours de clôture de l'Indice en utilisant le prix de clôture officiel de la bourse des actions le constituant.

L'Indice est révisé et rééquilibré semestriellement, en mai et en novembre, pour coïncider avec les révisions de l'Indice parent de mai et de novembre.

La fréquence de rééquilibrage décrite ci-dessus n'aura aucun impact en termes de coûts dans le contexte de la performance de l'objectif d'investissement.

L'Indice est un indice de rendement total net. Un indice de rendement total net mesure la performance des composantes de l'Indice selon le critère que tout dividende ou toute distribution sont intégrés dans les rendements de l'indice après retenue de l'impôt.

Informations complémentaires sur l'Indice

Des informations complémentaires sur l'Indice, sa composition, ses calculs et ses règles de révision et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale sous-tendant l'Indice, sont disponibles sur le site web du fournisseur de l'Indice : <https://www.msci.com>.

Pour de plus amples informations sur l'Indice, veuillez vous reporter au paragraphe B « Investissements effectués par le Compartiment indiciel » de la Section I « Objectif d'investissement / Pouvoirs et restrictions d'investissement » du présent Prospectus et à l'ANNEXE F – RÈGLEMENT BENCHMARK.

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Le Compartiment poursuivra son objectif d'investissement par le biais d'une réplification directe, tel que décrit et conformément à la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I/ Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions d'investissement du présent Prospectus.

Dans les limites établies dans le présent Prospectus et à titre accessoire, le Compartiment peut détenir des liquidités et des équivalents de trésorerie.

Le Compartiment n'investira pas plus de 10 % de ses actifs dans des parts ou actions d'autres OPCVM. Aucun investissement dans d'autres OPC ne sera effectué.

Le Compartiment intègre des Risques de durabilité et tient compte des principales incidences négatives des investissements sur les Facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'homme ou le Droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le Charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section

I « Objectifs d'investissement/Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».

De plus amples informations sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont disponibles à l'Annexe I – Publications d'informations ESG de ce Prospectus.

TECHNIQUES D'INVESTISSEMENT

Les proportions maximales et attendues des actifs du Compartiment pouvant être soumis à des SFT et TRS sont indiquées dans l'ANNEXE E – UTILISATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL.

ÉLIGIBILITÉ DU COMPARTIMENT

Veillez vous référer à l'ANNEXE G – RAPPORT D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUE pour obtenir des informations concernant le Compartiment et la loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (« InvStG-E »).

PROFIL D'INVESTISSEURS

Le Compartiment est destiné aux investisseurs de détail et institutionnels qui cherchent à être exposés à des sociétés de pays développés et émergents qui devraient dériver des revenus importants des secteurs qui ciblent les préférences des « millennials » et présentent des caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG).

CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Le Compartiment émettra les Catégories d'actions, sous réserve des différentes modalités décrites à l'ANNEXE C – SYNTHÈSE DES ACTIONS ET DES COMMISSIONS. D'autres Catégories d'actions peuvent être disponibles. Pour obtenir la liste actuelle des Catégories d'actions disponibles, rendez-vous sur www.amundiETF.com.

DÉFINITIONS

« Jour ouvré », « Jour de négociation » et « Jour de valorisation » : veuillez vous reporter à l'ANNEXE H - GLOSSAIRE.

« Heure limite de négociation » : veuillez vous référer à l'ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

COTATION

Le Compartiment est un OPCVM ETF. Par conséquent, toutes ses Actions seront négociées tout au long de la journée sur un ou plusieurs marchés réglementés ou systèmes multilatéraux de négociation avec au moins un teneur de marché qui prend des mesures pour s'assurer que la valeur boursière des Actions ne s'écarte pas significativement de sa VLi (telle que définie ci-

dessus).

En cas de Suspension du Marché secondaire (telle que définie ci-dessus dans le Prospectus), les frais de sortie suivants s'appliqueront (en remplacement des frais de rachat maximum indiqués ci-dessus) : 1 % de la Valeur liquidative par Action multiplié par le nombre d'actions rachetées.

Une liste de ces bourses et/ou systèmes multilatéraux de négociation peut être obtenue auprès du siège social de la Société.

Des informations sur la VLi des actions négociées en bourse sont également fournies à la section « Valeur liquidative indicative par action » de la partie principale du Prospectus et sur le site www.amundiETF.com.

PUBLICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

La Valeur liquidative par Action sera disponible au siège social de la Société et sera publiée sur www.amundiETF.com.

AVERTISSEMENT SUR LES RISQUES

Parmi les différents risques décrits à l'ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE, le Compartiment est plus particulièrement exposé aux risques suivants :

Risque lié aux actions, Risque de perte en capital, Risque lié à l'investissement dans les marchés émergent set en développement, Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation, Risque de perturbation de l'Indice, Risque de faible diversification, Risque de liquidité du Compartiment, Risque de liquidité sur le marché secondaire, Risque de contrepartie, Risque d'utilisation d'instruments financiers dérivés, Risque que l'objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint, Risque de change, Risque opérationnel, Risque d'opération de société, Risque d'érosion du capital, Risques liés à l'investissement dans des actions de petite et moyenne capitalisations, Risques liés au prêt de titres, Risque de gestion des garanties, Risques particuliers liés aux GDR et aux ADR, Risque de marché lié à une controverse, Risque lié aux méthodologies ESG, Risque lié au calcul de la note ESG, Risque de calcul de l'Indice.

RISQUES LIÉS À LA DURABILITÉ

Pour gérer les Risques de durabilité de ce Compartiment, la Société de gestion s'appuie sur MSCI en tant qu'administrateur de l'Indice, qui identifie et intègre les Risques de durabilité pertinents et significatifs dans sa méthodologie de notation ESG. Cette intégration a donc un impact direct sur l'univers d'investissement de l'Indice de référence. Toutefois, il ne peut être donné aucune assurance quant à l'élimination totale des Risques de durabilité et la survenance de tels risques pourrait avoir un impact négatif important sur la valeur des actifs composant l'Indice ou reflété par le Compartiment. Pour plus d'informations quant à la méthodologie de notation ESG de MSCI, veuillez consulter : <http://www.msci.com>.

De plus amples informations sont disponibles dans la

section « INVESTISSEMENT DURABLE » du Prospectus.

RÉPARTITION DES BÉNÉFICES

Veillez vous reporter à la section Politique de distribution du Prospectus.

AVIS DE NON-RESPONSABILITÉ

Le Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI Inc. (« MSCI »), ni par aucune filiale de MSCI, ni par aucune des entités impliquées dans l'établissement des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI, et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales et ont été concédés sous licence, à des fins spécifiques, par Amundi Asset Management. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production ou le calcul des indices MSCI n'ont fait de déclaration ou n'ont donné de garantie, expresse ou implicite, aux porteurs de parts du Compartiment ou, plus généralement, au grand public, concernant les mérites de la négociation de parts de fonds d'investissement en général ou de parts de ce Fonds en particulier, ou la capacité de tout indice MSCI à reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont propriétaires de certains noms, marques déposées et indices MSCI, qui sont déterminés, constitués et calculés par MSCI sans consultation avec Amundi Asset Management ou le Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne sont tenues de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des porteurs de parts du Compartiment lors de la détermination, de la constitution ou du calcul des indices MSCI. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI ne prennent de décision concernant la date de lancement, le prix, la quantité de parts du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour établir la valeur liquidative du Compartiment. Ni MSCI, ni aucune filiale de MSCI, ni aucune des entités impliquées dans la production des indices MSCI n'assument de responsabilité ou d'obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou/l'exhaustivité des indices ou de quelconques données qui y sont incorporées. Ni MSCI ni aucune autre partie impliquée dans la création d'un calcul des indices MSCI ne donne de garantie, expresse ou implicite, quant aux résultats qu'obtiendra le détenteur d'une licence MSCI, les clients dudit licencié ainsi que les contreparties, les porteurs de parts de fonds ou toute autre personne ou entité, de l'utilisation des indices ou de toutes données incluses en relation avec les droits donnés en licence ou pour toute autre

utilisation.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenue pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris d'un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

ANNEXE B – CONSIDÉRATIONS DE RISQUE SPÉCIFIQUE ET FACTEURS DE RISQUE

Tout investissement dans une société d'investissement à capital variable, telle la Société, comporte un certain risque incluant, de façon non limitative, les risques décrits ci-dessous. Cette description des risques liés aux investissements ne prétend pas à l'exhaustivité et il appartient aux investisseurs potentiels d'examiner attentivement le présent Prospectus dans son intégralité et de consulter leurs conseillers professionnels avant de demander à souscrire des Actions dans un Compartiment. La fluctuation des taux de change entre la devise du pays de domicile d'un investisseur et celle dans laquelle sont libellées les Actions peut entraîner une hausse ou une baisse de la valeur des Actions après conversion dans la devise du pays où l'investisseur est domicilié. Les Actionnaires devant acquitter une Commission de souscription initiale due au moment de la souscription, comme décrit au chapitre « Investir dans la Société sur le marché primaire », doivent considérer leur investissement dans une optique de moyen à long terme compte tenu de la différence entre le prix de souscription et le prix de rachat de leurs Actions.

Risque lié aux actions

Le prix d'une action peut augmenter ou diminuer en fonction de l'évolution des risques auxquels la société émettrice est exposée ou des conditions économiques prévalant sur les principaux marchés actions, en particulier sur le marché sur lequel l'action est négociée. Il peut également fluctuer au gré des anticipations des différents acteurs du marché. Les marchés actions sont susceptibles de connaître de fortes fluctuations et les actions peuvent en particulier se révéler plus volatiles que les obligations, étant donné qu'il est difficile d'estimer leurs revenus sur une période donnée avec une précision raisonnable lorsque les conditions macroéconomiques sont stables.

Risques liés à l'investissement dans les actions de moyenne capitalisation

Un Compartiment peut être exposé à des valeurs de moyenne capitalisation, ce qui peut augmenter les risques de marché et de liquidité. Par conséquent, les cours de ces titres montent ou baissent de façon plus accentuée que ceux des grandes capitalisations. La valeur liquidative du Compartiment pourrait évoluer de manière similaire et subir ainsi une baisse plus brutale que la valeur d'un investissement comparable dans des titres de grandes capitalisations.

Risque lié à l'investissement dans des valeurs de petite et moyenne capitalisation

Le Compartiment est exposé aux valeurs de petite et moyenne capitalisation et, plus particulièrement, aux titres d'entreprises de taille petite, moyenne ou intermédiaire, ce qui peut conduire à un accroissement des risques de marché et de liquidité. Par conséquent, les cours de ces titres montent ou baissent de façon plus accentuée que ceux des grandes capitalisations. La valeur liquidative du Compartiment pourrait évoluer de manière similaire et subir ainsi une baisse plus brutale que ne le ferait un investissement comparable dans des titres de grandes capitalisations.

Risque lié aux matières premières

Les marchés de matières premières présentent en général des risques plus importants, mais aussi plus variables que les autres marchés. Leurs prix peuvent donc être extrêmement volatils. Ils sont déterminés par les forces de l'offre et de la demande sur les marchés de matières premières, lesquelles sont notamment influencées par les comportements de consommation, les facteurs macro-économiques, les conditions météorologiques, les catastrophes naturelles ou d'autres événements imprévisibles, les mesures de contrôle gouvernementales et les politiques en matière budgétaire, monétaire et commerciale. La répartition géographique et la concentration des matières premières (elles sont souvent produites dans des pays émergents) peuvent en outre exposer le Compartiment à des problèmes tels que des risques politiques accrus, des actes de guerre, l'intervention des États et les éventuels prélèvements qu'ils opèrent sur la production ou l'augmentation des loyers et des taxes sur les ressources. À cela s'ajoute également le risque que la production industrielle fluctue considérablement, ce qui pourrait dégrader la performance du Compartiment concerné.

Risques liés aux contrats à terme standardisés composant l'indice/la stratégie

L'indice/la stratégie sous-jacent(e) de certains Compartiments est composé(e) de contrats à terme standardisés. Ils peuvent ainsi être soumis à un risque de liquidité caractéristique des transactions portant sur ces instruments dont le volume de transaction journalier peut être limité. L'exposition à l'Indice ou à la stratégie est maintenue en reconduisant les positions sur ces contrats. Cette opération consiste à transférer une position sur des contrats proches de leur échéance (ce transfert intervenant dans tous les cas avant l'expiration des contrats) sur des contrats d'échéance plus éloignée. Ces contrats comportent généralement une caractéristique de portage, le portage représentant le coût ou l'avantage lié à la détention d'un instrument financier. Si le portage est négatif, c'est-à-dire que le prix des contrats à terme standardisés est supérieur au cours au comptant de l'instrument sous-jacent, l'Indice/la stratégie risque de subir des pertes systématiques en maintenant durablement ou en renouvelant

des positions longues sur ces contrats. Si le portage est positif, c'est-à-dire que le prix des contrats à terme standardisés est inférieur au cours au comptant de l'instrument sous-jacent, l'Indice/la stratégie risque de subir des pertes systématiques en maintenant durablement ou en renouvelant des positions courtes sur ces contrats. En raison des coûts de transaction et du manque de liquidité potentiel, les investisseurs peuvent également être exposés à un risque de perte lors du renouvellement des contrats à terme. Ces facteurs pourraient donc dégrader progressivement la performance des Compartiments, notamment lorsqu'un investissement à long terme y est réalisé.

Risque lié à l'investissement dans des contrats à terme standardisés sur l'indice VIX

Un Compartiment est susceptible de conclure des transactions de contrats à termes standardisés sur l'indice VIX, lequel est représentatif de la volatilité de l'indice S&P 500. Il pourra dès lors être exposé à un risque de liquidité caractéristique des transactions portant sur ces instruments dont le volume journalier peut être limité. D'un point de vue historique, l'indice VIX Indice a affiché une volatilité élevée, qui, à certains moments, s'est même révélée très supérieure à celle du S&P 500.

Les contrats futures sur l'indice VIX peuvent présenter un portage très négatif (le portage représentant le coût ou l'avantage lié à la détention d'un instrument financier, indépendamment de la performance du marché sous-jacent), d'où le fait que le prix de ces contrats puisse être très supérieur au cours au comptant de l'indice VIX pendant de longues périodes. Le Compartiment risque alors de subir des pertes importantes en maintenant durablement des positions longues sur les contrats de futures adossés à l'indice VIX, quel que puisse être l'impact d'un changement des conditions de marché sur le niveau de l'indice. Néanmoins, le Compartiment peut aussi enregistrer de lourdes pertes lorsqu'il prend des positions courtes sur des contrats futures sur le VIX dans la mesure où le portage peut subitement devenir positif (prix des contrats de futures inférieur au cours au comptant de l'indice), ce qui est généralement le cas lors de pics de volatilité importants.

Risque lié à une faible diversification

Les investisseurs peuvent être exposés à un indice ou à une stratégie concentré(e) sur un nombre restreint de titres sous-jacents et/ou représentant un(e) région/secteur/stratégie spécifique et ne pas bénéficier d'une diversification aussi importante que dans le cas d'un indice/d'une stratégie plus large qui serait exposé(e) à plusieurs régions/secteurs/stratégies et/ou à un plus grand nombre de titres sous-jacents. Cela peut se traduire par une volatilité plus élevée qu'avec un indice/une stratégie diversifié(e) et à un risque de liquidité accru en cas de faible liquidité ou de suspension de cotation d'une ou plusieurs composantes de l'indice/la stratégie.

Risque de perte de capital

Le capital investi n'est pas garanti. Les investisseurs ne sont donc pas assurés de récupérer tout ou partie de leur mise de fonds initiale, en particulier si l'Indice de référence/la stratégie enregistre une performance négative sur la période d'investissement.

Risque d'érosion du capital

Par le biais d'un Compartiment, les Actionnaires peuvent être exposés au risque d'érosion potentielle du capital due à une hausse généralisée de l'inflation dont la performance du Compartiment ne tient pas compte.

Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers dérivés

L'emploi d'instruments financiers dérivés (« IFD ») tels que, entre autres, les contrats à terme standardisés (futures) ou de gré à gré (forwards), les options et les swaps va de pair avec des risques accrus.

Le montant initial pour établir une position sur certains IFD peut être beaucoup plus faible que l'exposition obtenue au moyen de cet instrument dérivé, de sorte que la transaction comporte un effet de levier. Une évolution du prix du marché relativement faible peut alors avoir une incidence notable, avec des effets bénéfiques ou préjudiciables pour le Compartiment. Néanmoins, sauf mention contraire dans les documents du Compartiment concerné, les produits dérivés à effet de levier ne sont pas utilisés pour engendrer un effet de levier au niveau du Compartiment. Les IFD sont très volatils et leur valeur vénale peut être sujette à des fluctuations considérables. Si les IFD ne fonctionnent pas comme prévu, le Compartiment peut subir des pertes plus lourdes que s'il n'avait pas recouru à ces IFD.

Un Compartiment peut conclure des contrats sur des IFD de gré à gré (cf. la section OBJECTIFS D'INVESTISSEMENT de la partie I du chapitre I/ Objectifs d'investissement / Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements du présent Prospectus). Les instruments négociés sur des marchés de gré à gré peuvent s'échanger dans des volumes plus étroits et leurs cours peuvent être plus volatils que ceux des instruments négociés sur des marchés réglementés.

Négocier ces IFD peut exposer le Compartiment à toute une gamme de risques, notamment ceux de contrepartie, de perturbation de couverture et de perturbation de l'indice ainsi que les risques fiscaux, réglementaires, opérationnels et de liquidité. Ces risques peuvent avoir de graves répercussions sur un IFD et pourraient entraîner une correction, voire un arrêt anticipé de la transaction sur cet IFD.

Risque de contrepartie

Un Compartiment peut être exposé au risque de contrepartie résultant de l'utilisation d'IFD de gré à gré ou de techniques de gestion efficace de portefeuille. Le Compartiment concerné peut être exposé au risque de faillite ou de défaut de règlement, ou de tout autre type de défaut de la contrepartie à tout contrat ou transaction conclus avec ce Compartiment.

Il peut être mis fin à la transaction ou au contrat en question par anticipation en cas de défaillance de la contrepartie. Dans le contexte de transactions sur IFD de gré à gré et/ou de techniques de gestion efficace de portefeuille, le Compartiment fera de son mieux pour atteindre ses objectifs d'investissement en concluant au besoin avec une autre contrepartie une transaction ou un accord équivalent aux conditions de marché qui seront en vigueur à la survenance de cet événement. La matérialisation de ce risque pourrait en particulier avoir des répercussions sur la capacité du Compartiment d'atteindre son objectif d'investissement.

Dans le cas du prêt de titres, si la contrepartie manque à son obligation de restituer les titres prêtés au Fonds, ce dernier cherchera à réaliser le nantissement détenu à titre de garantie financière. Cette réalisation de la garantie pourrait toutefois générer un revenu inférieur à celui des titres initialement prêtés à la contrepartie et réduire l'exposition du portefeuille ciblé par le Fonds jusqu'à ce que la garantie soit reconvertie dans le titre d'origine.

La Société de gestion surveille ces risques de conflits d'intérêt par la mise en place de procédures veillant à les identifier, à les limiter et à les résoudre de manière équitable, le cas échéant.

Risque lié à la gestion des garanties

Le risque de contrepartie découlant des investissements dans des produits financiers dérivés de gré à gré ou des techniques de gestion efficace de portefeuille, comme décrit plus en détail à la section E. « Techniques d'investissement » de la partie générale du Prospectus, est généralement atténué par le transfert ou le nantissement de garanties en faveur du Compartiment. Néanmoins il est possible que les opérations ne soient pas pleinement garanties. Les frais et les rendements dus au Compartiment ne peuvent pas être garantis. Si une contrepartie fait défaut, le Compartiment peut être amené à vendre des garanties autres qu'en numéraire reçues au cours en vigueur sur le marché. Dans un tel cas, le Compartiment pourrait essuyer une perte du fait, entre autres, d'une estimation ou d'un suivi inadéquat des garanties, d'une évolution défavorable du marché, d'une détérioration de la note de crédit des émetteurs de la garantie ou de l'illiquidité du marché sur lequel se négocie la garantie. La difficulté de revendre les garanties est susceptible de retarder ou de limiter la capacité du Compartiment à honorer les demandes de rachat.

Le risque de gestion des garanties implique également (i) le risque opérationnel, à savoir le risque que les processus opérationnels, y compris ceux liés à la conservation des actifs, à l'évaluation et au traitement des transactions, puissent échouer, entraînant des pertes, en raison d'erreurs humaines, de défaillances des systèmes physiques et électroniques et d'autres risques liés à l'exécution des activités, ainsi que d'événements extérieurs et (ii) le risque de conservation, dans lequel les actifs du Fonds sont conservés par le Dépositaire et l'Agent Payeur et les investisseurs sont exposés au risque que le Dépositaire et l'Agent Payeur ne soient pas en mesure de remplir pleinement leur obligation de restituer dans un bref délai tous les actifs du Fonds en cas de faillite du Dépositaire et de l'Agent Payeur. Les actifs du Fonds seront identifiés dans les livres du Dépositaire et Agent Payeur comme appartenant au Fonds. Les titres et obligations (y compris les cessions de prêts et les participations à des prêts) détenus par le Dépositaire et l'Agent payeur feront l'objet d'une ségrégation des autres actifs du Dépositaire et de l'Agent payeur, le risque de défaut de restitution est donc minimisé mais ne doit pas être exclu en cas de faillite. Cependant, cette ségrégation n'est pas applicable aux liquidités, ce qui accroît le risque de non-restitution en cas de faillite.

Risque de taux d'intérêt

Risque global

Le risque de taux d'intérêt fait référence aux fluctuations de la valeur d'un titre à taux fixe découlant de la variation du niveau général des taux d'intérêt. Lorsque le niveau général des taux d'intérêt augmente, le prix de la plupart des titres à taux fixe baisse. Lorsque le niveau général des taux d'intérêt diminue, le prix de la plupart des titres à taux fixe monte. Le risque de taux d'intérêt est généralement plus important pour les titres assortis de durations ou de maturités longues. Les fluctuations des taux d'intérêt peuvent dès lors avoir un impact favorable ou défavorable sur la valeur liquidative du Compartiment.

Compartiments destinés à offrir des rendements liés aux taux du marché monétaire

Un Compartiment peut être exposé aux fluctuations des marchés monétaires pouvant résulter d'une décision prise par une banque centrale. En conséquence, un recul des taux d'intérêt du marché monétaire à un niveau inférieur à la Commission de gestion et à la Commission administrative du Compartiment pourrait entraîner une baisse de sa valeur liquidative. Il se peut que le taux de référence du marché monétaire soit négatif sur une certaine période, ce qui pourrait entraîner des performances négatives du Compartiment au cours de cette période.

Compartiments appliquant une stratégie neutre en duration (à l'instar des Compartiments conçus pour offrir des rendements liés aux anticipations d'inflation)

Un Compartiment peut adopter une stratégie neutre en duration, c'est-à-dire une stratégie conçue de façon à minimiser l'impact des variations des taux d'intérêt. Toutefois, le Compartiment pourrait être exposé à des fluctuations des taux d'intérêt en raison d'une correspondance imparfaite des échéances des obligations entre la position vendeuse et la position acheteuse. En outre, une exposition résiduelle au risque de taux d'intérêt peut exister en raison des variations des prix des obligations sous-jacentes depuis le dernier rééquilibrage. Les fluctuations des taux d'intérêt peuvent dès lors avoir un impact favorable ou défavorable sur la valeur liquidative du Compartiment.

Risque de crédit :**Généralités**

En raison de son exposition aux obligations et aux autres titres du marché obligataire, un Compartiment court le risque que certains émetteurs fassent faillite ou ne puissent honorer leurs échéances de paiement des intérêts et/ou du principal dus sur ces titres.

En outre, il se peut que la santé financière d'un émetteur se détériore et que la qualité de sa signature ou de ses titres s'amoiñsse, avec à la clé un risque accru de défaut de cet émetteur et, par suite, une baisse de la valeur des titres concernés. La détérioration de la qualité de crédit d'un émetteur peut également accroître la volatilité du prix des titres émis par ce dernier, et partant, de la valeur du Compartiment.

Compartiments appliquant une stratégie neutre à l'égard du crédit (à l'instar des Compartiments conçus pour offrir des rendements liés aux anticipations d'inflation)

Le Compartiment pourrait être exposé à une évolution de la qualité de crédit d'une obligation incluse dans l'Indice de référence/la stratégie en raison de la correspondance imparfaite des obligations entre la position vendeuse et la position acheteuse. Une évolution réelle ou perçue de la capacité d'un émetteur à s'acquitter de ses obligations serait probablement préjudiciable au Compartiment.

Risques liés aux techniques d'échantillonnage et d'optimisation

Il peut s'avérer coûteux et difficile de répliquer la performance de l'Indice/la stratégie en investissant dans chacune de ses composantes. Il se peut que certaines composantes ne soient pas négociées en raison, par exemple, d'embargos internationaux ou de suspensions de la cotation sur le marché. Aussi le gérant du Compartiment peut avoir recours à des techniques d'optimisation et/ou d'échantillonnage. Ces techniques d'échantillonnage consistent à investir dans une sélection de titres représentatifs (et non dans tous les titres) composant l'Indice/la stratégie, dans des proportions différentes de celles de l'Indice/la stratégie. S'agissant des techniques d'optimisation, le Compartiment peut investir dans des titres autres que les composantes de l'Indice/la stratégie ou dans des instruments dérivés. Le recours à ces techniques peut entraîner une augmentation de l'écart de suivi ex post et conduire à des performances différentes entre le Compartiment et l'Indice/la stratégie.

Manque de réactivité aux changements de circonstances

Conformément à sa méthode de construction, l'Indice que répliquent certains Compartiments fait l'objet de rééquilibrages peu fréquents. Si un changement de circonstances affecte la réalisation des objectifs de l'Indice entre deux dates de rééquilibrage, y compris peu après une date de rééquilibrage, les composantes de l'Indice ou leur pondération ne seront pas modifiées avant la date de rééquilibrage suivante. En conséquence, l'Indice peut ne pas réagir aussi rapidement aux changements de circonstances qu'une stratégie gérée de manière active.

Absence d'historique

L'Indice/la stratégie répliqué(e) par certains Compartiment est récent(e) et il/elle ne dispose dès lors que d'un historique limité pour évaluer ses performances. Tout test à rebours ou analyse similaire effectué par quiconque relativement à l'Indice/la stratégie concerné(e) doit être considéré comme n'ayant qu'une valeur indicative et susceptible de reposer sur des estimations ou des hypothèses.

Avertissement sur les risques liés à l'utilisation d'instruments financiers dérivés

L'emploi d'instruments financiers dérivés tels que les contrats à terme standardisés (futures) ou de gré à gré (forwards), les options, les bons de souscription (warrants) et les swaps (notamment les TRS) va de pair avec des risques accrus. La capacité d'un Compartiment de les utiliser avec succès dépend de l'aptitude de son Gestionnaire à anticiper à bon escient l'évolution des cours de Bourse, des taux d'intérêt, des taux de change ou d'autres paramètres économiques ainsi que de l'existence de marchés liquides. Si les anticipations du Gestionnaire sont erronées ou si les instruments dérivés ne fonctionnent pas comme prévu, le Compartiment peut subir des pertes plus lourdes que s'il n'avait pas recouru à ces instruments. Certains instruments financiers dérivés peuvent avoir besoin d'un montant initial pour établir une position dans cet instrument dérivé beaucoup plus faible que l'exposition obtenue au moyen de cet instrument dérivé, de telle sorte que ce type de transaction comporte un effet de levier. Une variation des cours relativement modeste peut alors avoir une incidence notable, avec des effets bénéfiques ou préjudiciables pour le Compartiment. Néanmoins, sauf mention contraire dans les documents du Compartiment concerné, les produits dérivés à effet de levier ne sont pas utilisés pour engendrer un effet de levier au niveau du Compartiment.

Les instruments financiers dérivés sont très volatils et leur valeur vénale peut être sujette à des fluctuations considérables. Si les instruments financiers dérivés ne fonctionnent pas comme prévu, le Compartiment peut subir des pertes plus lourdes que s'il n'avait pas recouru à ces instruments financiers dérivés.

Les instruments négociés sur des marchés de gré à gré peuvent être négociés dans des volumes étroits et leurs cours peuvent être plus volatils que ceux des instruments négociés sur des marchés réglementés.

Tout Compartiment peut conclure des contrats sur des instruments financiers dérivés de gré à gré (Cf. la section OBJECTIFS ET POLITIQUE D'INVESTISSEMENT / POUVOIRES ET RESTRICTIONS EN MATIÈRE D'INVESTISSEMENTS de la partie I du présent Prospectus). Négocier ces instruments financiers dérivés peut exposer le Compartiment à toute une gamme de risques, notamment ceux de contrepartie, de perturbation de couverture et de perturbation de l'indice ainsi que les risques fiscaux, réglementaires, opérationnels et de liquidité. Ces risques peuvent avoir une forte incidence sur un instrument financier dérivé et peuvent induire un ajustement, voire la résiliation anticipée de la transaction y relative.

Risque juridique – Instruments dérivés de gré à gré, Opérations de prise en pension, Prêts de titres et Réutilisation des garanties

Certaines opérations sont conclues sur la base de documents juridiques complexes. Ces documents peuvent être difficiles à exécuter ou peuvent faire l'objet d'une contestation quant à leur interprétation dans certains cas. Si les droits et les obligations des parties à un document juridique peuvent être régis par le droit anglais, dans certains cas (par exemple dans le cas des procédures pour insolvabilité) d'autres systèmes judiciaires peuvent prévaloir, ce qui peut affecter l'exécution d'opérations existantes.

Risque lié à l'investissement dans les pays émergents et en voie de développement

L'exposition aux marchés émergents entraîne un risque de pertes plus élevé que sur les marchés développés. Plus précisément, les règles de fonctionnement et de surveillance des marchés peuvent s'écarter sensiblement des normes en vigueur sur les marchés développés. En particulier, l'exposition aux marchés émergents est sujette à des facteurs tels que : la plus forte volatilité des marchés, le volume plus étroit des transactions, le risque d'instabilité économique et/ou politique, des règles fiscales et un environnement réglementaire incertains ou capricieux, le risque de fermeture des marchés, l'instauration de restrictions sur les investissements étrangers par l'État et l'interruption ou la limitation de la convertibilité ou des transferts de fonds dans la devise d'un pays émergent.

Risque de change

Cas des Compartiments dont l'objectif est de répliquer un Indice ou de refléter la performance d'un Indice de référence ou d'une Stratégie de référence

Un Compartiment peut être exposé à un risque de change si (i) les composantes de l'Indice de référence/la stratégie sont libellées dans une autre devise que celle de la Classe détenue par l'investisseur, ou si (ii) certaines Catégories du Compartiment sont cotées sur certaines Bourses et/ou systèmes de négociation multilatérale dans une devise différente de celle des composantes de l'Indice de référence/la stratégie. Chaque investisseur peut donc être exposé à des fluctuations du taux de change entre la devise de son investissement et la devise de chaque composante de l'Indice de référence/la stratégie. Ces fluctuations peuvent donc avoir un impact défavorable sur la performance de l'investissement de chaque Actionnaire.

Les investisseurs doivent être conscients que, lorsque leur devise d'investissement est différente de la devise de base de l'Indice de référence, la performance de leur investissement peut varier par rapport à celle de l'indice de

référence en raison des fluctuations du taux de change. Par exemple, la performance de l'investissement de tout Actionnaire peut être négative même si la valeur de l'Indice de référence augmente.

Cas des Compartiments dont l'objectif d'investissement n'est pas lié à un Indice, un Indice de référence ou un Portefeuille de référence

Un Compartiment peut être exposé à un risque de change si (i) les actifs auxquels est exposé le Compartiment sont libellés dans une autre devise que la devise de la Classe détenue par l'investisseur, ou si (ii) le Compartiment est coté sur certaines Bourses et/ou systèmes de négociation multilatérale dans une devise différente de celle des actifs auxquels est exposé le Compartiment. Chaque investisseur peut donc être exposé à des fluctuations du taux de change entre sa devise d'investissement et la devise des actifs auxquels est exposé le Compartiment, lesquelles peuvent être préjudiciables à la performance de son investissement.

Risque de couverture de change de la Catégorie

Pour couvrir (entièrement ou partiellement) le risque de change des Classes couvertes, le Compartiment est susceptible d'utiliser une stratégie de couverture essayant de réduire l'impact des fluctuations de la devise de la Classe concernée par rapport à la devise de chaque composante ou de certaines composantes de l'Indice de référence/la stratégie. Cependant, la stratégie de couverture utilisée par le Compartiment peut s'avérer imparfaite en raison de la fréquence de rééquilibrage et des instruments utilisés. La Valeur liquidative de la Catégorie concernée peut alors être affectée par les mouvements du marché des devises fluctuant à la hausse comme à la baisse. De plus, les coûts de couverture peuvent également avoir un impact négatif sur la Valeur liquidative de la Catégorie concernée. L'adoption d'une stratégie de couverture de risque de change pour une Classe peut limiter sensiblement la capacité des détenteurs de cette Classe à bénéficier de la hausse d'une ou de plusieurs devises des composantes de l'Indice de référence/la stratégie par rapport à la devise de cette Classe.

Risque de liquidité du Compartiment (sur le marché primaire)

La liquidité et/ou la valeur du Compartiment peut être affectée de façon défavorable si, lorsque le Compartiment (ou une contrepartie d'un instrument financier dérivé) rééquilibre son exposition, les marchés financiers sous-jacents sont fermés, si les transactions qui peuvent y être exécutées sont limitées ou si les fourchettes de cours acheteurs et vendeurs y sont anormalement larges. L'incapacité à exécuter des ordres en raison de faibles volumes de négociation peut également affecter les processus de souscription, de conversion et de rachat d'Actions.

Risque de liquidité sur le marché secondaire

Les investisseurs sont invités à consulter la section V. Marché secondaire pour les Catégories d'Actions / Compartiments UCITS ETF qui figure dans la partie principale du présent prospectus.

Risque que l'Objectif d'investissement du Compartiment ne soit que partiellement atteint

Il n'existe aucune garantie que l'objectif d'investissement du Compartiment soit atteint, aucun actif ni instrument financier ne permettant en effet de reproduire l'Indice automatiquement et en permanence, en particulier si un ou plusieurs des risques suivants se produisent :

(a) Risque dû à l'évolution de la fiscalité

Toute modification de la législation fiscale d'un pays où un Compartiment est domicilié, autorisé à la vente ou coté, pourrait avoir des répercussions défavorables sur le traitement fiscal des Actionnaires de chaque Compartiment. Le cas échéant, la Société de gestion de ce Compartiment ne pourra être tenue pour responsable vis-à-vis d'un quelconque investisseur d'un quelconque paiement que la Société ou le Compartiment correspondant est tenu d'effectuer au profit d'une administration fiscale compétente.

(b) Risque dû à l'évolution de la fiscalité des actifs sous-jacents

Toute modification de la législation fiscale applicable aux actifs sous-jacents d'un Compartiment pourrait avoir des répercussions défavorables sur le traitement fiscal de ce Compartiment. Ainsi, la valeur liquidative de ce Compartiment peut être affectée en cas d'écart entre le traitement fiscal prévu et celui qui est effectivement appliqué au Compartiment et/ou à la contrepartie du swap de gré à gré (dans le cas de Compartiments appliquant une Réplication indirecte).

La valeur liquidative peut aussi être affectée lorsque le Compartiment pourrait devoir rembourser des taxes imprévues liées à une position de couverture initiée par une contrepartie IFD (existante ou passée) du Compartiment dans le cadre d'un swap de gré à gré.

(c) Risque réglementaire affectant le Compartiment

Le déroulement des souscriptions, conversions et rachats d'Actions peut être perturbé en cas de modification du régime réglementaire en vigueur dans tout pays dans lequel un Compartiment est domicilié, autorisé à la vente ou coté.

(d) Risque réglementaire affectant les actifs sous-jacents du Compartiment

La modification du régime réglementaire en vigueur dans tout pays où se trouvent les actifs sous-jacents d'un Compartiment peut avoir une incidence sur la valeur liquidative de ce Compartiment, ainsi que sur le déroulement des souscriptions, conversions et rachats d'Actions. Un Compartiment peut ne pas être en mesure d'obtenir une exposition à certains titres inclus dans l'indice sous-jacent ou de le faire dans les proportions exactes qu'ils représentent en raison de restrictions réglementaires, politiques ou légales ou d'autres raisons de même nature. De telles restrictions ou des restrictions similaires peuvent également amener le fournisseur d'indices à modifier l'indice cible d'un Compartiment en supprimant des titres d'un indice ou en mettant en œuvre des plafonnements sur les titres de certains émetteurs qui ont été soumis à de telles mesures. Cela peut également avoir un effet défavorable sur la capacité d'un compartiment à ajuster son exposition à la valeur d'un panier de valeurs mobilières ou d'autres actifs éligibles correspondant à son objectif d'investissement et, le cas échéant, entraîner une augmentation des frais de transaction et du risque d'écart de suivi.

(e) Risque de perturbation de l'Indice

En cas de perturbation de l'Indice, la Société, agissant conformément à la législation et la réglementation en vigueur, peut être amenée à suspendre le calcul de la valeur liquidative du Compartiment. Si la perturbation de l'Indice persiste, la Société décidera des mesures appropriées qu'il convient de mettre en œuvre. Une perturbation de l'Indice recouvre notamment les cas suivants :

- i) l'Indice est réputé inexact ou il ne reflète pas l'évolution réelle du marché ;
- ii) l'Indice est annulé définitivement par le fournisseur de l'Indice ;
- iii) le fournisseur de l'Indice ne calcule ou n'annonce pas le niveau de l'Indice ;
- iv) le fournisseur de l'Indice apporte à la formule de calcul ou à la méthode construction de l'Indice (en dehors d'une modification déjà prescrite par cette formule ou cette méthode en cas de modification ordinaire de ses composantes et pondérations et en dehors d'autres événements de routine) un changement notable qui ne peut être reproduit efficacement par un Compartiment à un coût raisonnable ;
- v) une ou plusieurs composantes de l'Indice deviennent illiquides, soit sur un marché réglementé (suspension des cotations) soit sur un marché de gré à gré ;
- vi) les composantes de l'Indice subissent des coûts de transaction liés à l'exécution ou au règlement, ou du fait de contraintes fiscales spécifiques, sauf si ces coûts sont intégrés dans la performance de l'Indice.

(f) Risque opérationnel

En cas de défaillance opérationnelle de la Société de gestion ou de l'un de ses représentants, des retards, des pertes ou d'autres perturbations peuvent intervenir dans le traitement des souscriptions, conversions et rachats d'Actions

(g) Risque d'opération sur titres

Une opération sur titres affectant une composante d'un Indice de référence et pour laquelle une annonce officielle a déjà été faite peut faire l'objet d'une révision imprévue et contradictoire. Dès lors que la valorisation du Compartiment intègre les informations relatives à l'opération sur titres qui ont été communiquées initialement, une telle révision peut avoir une incidence négative sur sa valeur liquidative. La performance du Compartiment risque en outre de s'écarter de celle de l'Indice de référence si le traitement de l'opération sur titres effectué par le Compartiment diffère de celui préconisé dans la méthode de construction de l'Indice de référence.

Prêts de titres

Dans le cadre des opérations de prêt de titres, les investisseurs doivent notamment être conscients que (A) en cas de défaut de l'emprunteur des titres ou des instruments prêtés par le Compartiment, si l'Agent de prêt ne les restitue pas ou ne dédommage pas le Compartiment en vertu des clauses d'indemnisation en cas de défaut de l'emprunteur stipulées dans le Contrat avec l'Agent de prêt, il existe un risque que la garantie reçue soit réalisée pour une valeur inférieure à celle des titres ou des instruments prêtés, que ce soit en raison d'une valorisation incorrecte, d'évolutions défavorables du marché, d'une détérioration de la notation du crédit de ses émetteurs, ou de l'illiquidité du marché sur lequel la garantie est négociée ; (B) le réinvestissement éventuel d'une garantie en numéraire peut (i) engendrer un effet de levier avec des risques inhérents et un risque de pertes et de volatilité, (ii) introduire un

risque de marché incompatible avec les objectifs d'un Compartiment, ou (iii) générer un rendement inférieur au montant de la garantie qui doit être restituée ; et que (C) la restitution tardive des titres ou des instruments prêtés peut restreindre la capacité d'un Compartiment à remplir ses obligations de livraison en vertu des ventes de titres.

Risque quantitatif (variance minimale)

La méthode de la variance minimale s'appuie sur un algorithme d'optimisation de la variance sous contrainte. Dans certains cas, il se peut que la variance obtenue ne soit pas la plus basse ou la plus optimale et que le profil de risque de l'Indice obtenu diffère de celui de l'univers d'investissement initial.

Risque de modélisation

Certaines méthodes de construction d'Indice peuvent faire appel à des processus d'investissement systématique, qui consistent en des modèles mathématiques quantitatifs ou des règles d'investissement systématique, basées sur des scénarios construits à partir de valeurs ou de performances historiques, d'événements de risque observés et d'autres données ou indicateurs financiers. Ces modèles et leurs hypothèses sous-jacentes peuvent se révéler erronés et il existe un risque que les objectifs d'investissement de l'Indice de référence ne soient que partiellement atteints.

Risque lié aux instruments indexés sur l'inflation

Une obligation indexée sur l'inflation offre un taux d'intérêt réel fixe (c.-à-d. après déduction du taux de l'inflation) et la totalité des flux financiers qu'elle génère (coupons et principal) sont indexés sur le taux d'inflation du pays ou de la zone d'émission. Outre le risque de taux d'intérêt présenté ci-dessus qui s'applique aux taux d'intérêt réels, cette obligation est donc exposée aux variations de l'inflation réalisée et de l'inflation anticipée jusqu'à sa date d'échéance. Une diminution du taux d'inflation se traduira par une baisse de la valeur de l'obligation indexée sur l'inflation. La variation du taux d'inflation peut donc avoir une incidence sur la valeur liquidative du Compartiment. Le taux de l'inflation sur lequel les obligations sont indexées est généralement associé à un indice des prix à la consommation dans le pays ou la zone d'émission. Il est donc lié à la situation économique du pays ou de la zone en question. Certains Compartiments peuvent également conclure des swaps d'inflation, permettant d'obtenir une exposition directe à l'inflation, longue ou courte, indépendamment des taux d'intérêt réels.

Risque spécifique lié aux effets de saisonnalité, de portage et de rétroactivité sur l'inflation

L'inflation peut être sujette à des fluctuations saisonnières qui peuvent avoir une incidence sur le rendement des obligations indexées sur l'inflation et générer un portage positif ou négatif (le portage d'un actif représentant le coût ou l'avantage lié à la détention de l'actif en question). L'effet de portage est positif lorsque l'inflation mensuelle cumulée est supérieure au coût du financement de la transaction sur le marché des pensions ; dans le cas contraire, l'effet de portage est négatif. L'inflation cumulée peut être négative et amplifier l'effet de portage négatif. Les chiffres de l'inflation sont générés de façon rétrospective et un délai de plusieurs mois peut s'écouler entre la collecte des données et l'indexation.

Risque lié aux anticipations d'inflation

Certains Compartiments peuvent être exposés à une stratégie long/short qui est sensible à l'évolution des anticipations d'inflation, susceptibles de varier à la baisse comme à la hausse, et reflète l'opinion du marché en matière macroéconomique à un moment donné. L'Indice de référence ne permet donc pas de mesurer ou de prévoir le taux d'inflation réalisé et n'a pas non plus pour objectif de reproduire la performance d'un indice de prix ni de mesurer le niveau réel des prix à la consommation. Le point mort d'inflation (PMI), qui désigne l'écart de rendement à une échéance donnée entre une obligation nominale et l'obligation indexée sur l'inflation équivalente et peut être exploité en prenant une position acheteuse sur l'obligation indexée sur l'inflation associée à une position vendeuse sur l'obligation nominale, est considéré comme une mesure des anticipations du marché en matière d'inflation au cours de la période considérée. Afin de dissiper toute ambiguïté, la performance journalière de l'Indice de référence ne sera pas mesurée par la variation quotidienne en pourcentage du PMI, ni par un multiplicateur de la variation quotidienne du PMI, mais par la surperformance quotidienne du panier de positions acheteuses liées à l'inflation par rapport au panier de positions vendeuses sur obligations nominales, laquelle est théoriquement corrélée à l'évolution de l'inflation attendue par le marché à l'échéance des obligations, représentée par le PMI à l'échéance considérée. Néanmoins, il n'existe aucune garantie que l'Indice de référence pertinent soit corrélé au PMI car la stratégie qui le sous-tend est également sensible à des facteurs et des risques supplémentaires, comprenant (entre autres) les mouvements de prix découlant des divergences d'offre et de demande entre les OII et les obligations nominales correspondantes, les taux d'intérêt, le risque de crédit, les effets de saisonnalité de l'inflation et les frais de transaction applicables aux composants de l'Indice de référence. Ces facteurs supplémentaires donneront lieu à des écarts entre la performance de l'Indice de référence et les variations des anticipations d'inflation. Un investissement dans ces Compartiments ne permet donc pas d'offrir une protection efficace contre l'inflation, ni de répliquer le PMI avec précision.

Risque lié à l'effet de levier

Certains Compartiments peuvent être exposés directement ou indirectement (via leur exposition à l'Indice qu'ils répliquent) aux actifs ou marchés sous-jacents. L'effet de levier engendre des risques spécifiques. En effet, il amplifie les mouvements des actifs sous-jacents à la hausse comme à la baisse, ce qui accroît la volatilité du Compartiment. Un niveau de levier important implique qu'une baisse modérée d'un ou de plusieurs actifs sous-jacent(s) pourrait entraîner une perte de capital importante pour le Compartiment. Enfin, le levier implique une hausse proportionnelle des coûts d'investissement du Compartiment, en particulier les coûts de réplification et les coûts de transaction.

Risque lié à une réduction de l'exposition du Compartiment à l'effet de levier

Un Compartiment peut réduire son exposition à l'Indice (ou à tout autre actif auquel il est exposé) à tout moment en vue d'éliminer tout risque de dépassement de la perte maximale acceptable. Un processus de réduction de l'exposition du Compartiment après une perte en capital peut entraîner un coût d'opportunité important. Le Compartiment pourrait effectivement ne pas être exposé, ou entièrement exposé, pendant des périodes qui pourraient être très rentables et, par conséquent, sous-performer de façon significative par rapport à un portefeuille par ailleurs identique, non soumis à une telle politique de contrôle du risque. La réduction de l'exposition du Compartiment peut réduire son potentiel bénéficiaire de façon proportionnelle.

Risques spécifiques liés aux Global Depository Receipts (« GDR ») et aux American Depository Receipts « ADR » :

L'exposition aux GDR et aux ADR peut générer des risques additionnels par rapport à une exposition directe aux actions sous-jacentes correspondantes :

(i) Dans la mesure où le prix du marché d'un GDR ou d'un ADR peut dévier de son prix théorique, qui est égal au prix de marché de l'action sous-jacente convertie en USD ou en GBP, au cours du change respectif au comptant. Cette déviation peut s'expliquer par différentes causes comme des quotas de négociation ou des restrictions légales applicables aux actions sous-jacentes locales, un écart entre les volumes de transaction des GDR ou des ADR et des actions sous-jacentes locales, ou d'autres dysfonctionnements sur les marchés d'actions concernés ;

(ii) en raison de l'intervention de la banque dépositaire qui émet les GDR ou les ADR. En vertu des lois applicables, la banque dépositaire qui détient les actions sous-jacentes en tant que couverture, ne peut pas séparer ces actions sous-jacentes de ses propres actifs. Bien que la ségrégation des actifs fasse partie intégrante de l'accord de dépositaire réglementant l'émission desdits ADR et GDR, il pourrait y avoir un risque que les actions sous-jacentes ne soient pas attribuées aux détenteurs d'ADR et de GDR en cas de faillite de la banque dépositaire. Dans ce cas, le scénario plus probable serait la suspension des échanges et, par la suite, un gel du prix des ADR et GDR affectés par cette faillite. Les faillites impliquant les banques dépositaires qui émettent des GDR et des ADR peuvent nuire à la performance et/ou à la liquidité du Compartiment concerné.

La performance d'un Indice composé de GDR ou d'ADR peut donc s'écarter de celle du portefeuille correspondant composé des titres locaux sous-jacents.

Risques liés au coût élevé d'un investissement dans une stratégie long/short et/ou à effet de levier

Il est nettement plus coûteux d'investir dans une stratégie long/short et/ou à effet de levier que dans de simples stratégies traditionnelles. Cela s'explique notamment par le coût de financement du levier et par le coût d'emprunt lié aux expositions synthétiques courtes. Les investisseurs du Compartiments qui suivent cette stratégie assument ces coûts en dernier ressort et pâtissent des répercussions négatives d'un investissement à long terme dans le Compartiment, indépendamment de la performance de la stratégie sous-jacente.

Risque spécifique lié à la notation du crédit par différentes agences

Selon la méthodologie de l'Indice/la stratégie répliqué/suivi par certains Compartiments, une obligation pourra y être incluse en fonction des notes de crédit émises par plusieurs agences de notation (si disponibles). Au regard de la notation attribuée par une agence donnée (y compris une agence autre que celles spécifiées dans la méthodologie de l'Indice/la stratégie), une ou plusieurs composantes de l'Indice/la stratégie pourraient ne pas être éligibles en raison d'un niveau de qualité de crédit différent.

Risque spécifique lié à la Loi PIR

Le Compartiment a l'intention de se conformer à l'ensemble des exigences de la Loi PIR, qui constitue le cadre du régime d'épargne individuelle à long terme instauré en Italie par le biais de la loi de finances 2017, en répliquant l'Indice.

Cependant, sa capacité à s'y conformer pourrait être affectée par certains facteurs tels que des mises à jour de la méthodologie du fournisseur de l'Indice, le retrait de la cote ou des changements affectant l'inclusion de titres détenus par le Compartiment, ou le fait que les titres ne remplissent plus les critères fixés par la Loi PIR. Lorsque

les titres en question sont des composantes de l'Indice, ils resteront dans l'Indice et pourront dès lors demeurer dans le portefeuille du Compartiment jusqu'à leur retrait de l'Indice au prochain rééquilibrage prévu. Outre les composantes de l'Indice, le Compartiment pourra également détenir d'autres titres dans des circonstances exceptionnelles. La Société de gestion pourra gérer ces événements à sa discrétion. En outre, le cadre réglementaire de la Loi PIR est susceptible d'évoluer de temps à autre, ce qui pourrait entraîner une modification de l'Indice ou de la politique d'investissement, sous réserve de l'approbation de la CSSF.

Risque de marché lié à une controverse

Les sociétés qui ont précédemment satisfait aux critères de sélection d'un indice de référence, et qui ont donc été incluses dans un indice de référence et le Compartiment concerné, peuvent, de manière inattendue ou soudaine, être touchées par une grave controverse ayant un impact négatif sur le cours de leurs actions et, par conséquent, sur la performance du Compartiment. Cela peut se produire lorsque des activités ou des pratiques de sociétés qui étaient auparavant dissimulées sont soudainement révélées et que le sentiment négatif des investisseurs qui en résulte risque de faire baisser leur prix. Si ces sociétés sont des composantes existantes de l'indice de référence, elles peuvent rester dans l'indice de référence et donc continuer à être détenues par le Compartiment jusqu'au prochain rééquilibrage prévu. Au moment où l'indice de référence exclut les titres concernés, le prix des titres peut avoir déjà chuté et ne pas s'être encore redressé, et le Compartiment peut donc être amené à vendre les titres concernés à un prix relativement bas.

Risque lié aux méthodologies ESG

Les indices comportant une composante environnementale, sociale et de gouvernance (« **ESG** ») utilisent généralement une approche « best in class » ou une approche d'amélioration de la notation ESG. Ces deux approches se rapportent à un univers d'investissement. Il peut toutefois arriver que des sociétés ayant une faible notation ESG soient incluses dans la composition de l'indice et que la notation ESG globale de l'indice soit inférieure à la notation ESG globale d'un indice non ESG basé sur un univers d'investissement différent.

Risque lié au calcul des notes ESG

Il convient de noter que la plupart des scores et des notations ESG ne sont pas définis en termes absolus, mais en termes relatifs, en comparant une entreprise à un groupe de pairs. Par conséquent, des entreprises généralement perçues par le marché comme ayant des pratiques ESG médiocres pourraient être potentiellement bien notées si les autres entreprises de leur groupe de pairs avaient des normes moins élevées que les leurs en termes de pratiques ESG. La note ESG des entreprises est calculé par une agence de notation ESG sur la base de données brutes, de modèles et d'estimations qui sont collectés/calculés selon des méthodes spécifiques à chaque acteur. La plupart d'entre elles utilisent une variété de vecteurs et de canaux d'information : questionnaires envoyés aux entreprises, utilisation d'informations publiées par les entités concernées par les données ou par des tiers de confiance (agences de presse, agences non gouvernementales), utilisation de données produites par d'autres fournisseurs du secteur par le biais d'abonnements ou de partenariats. Les informations recueillies peuvent être complétées, précisées ou corrigées sur la base d'échanges avec les entreprises auxquelles elles se rapportent. Les agences de notation publient des indications sur leur méthodologie et fournissent des informations supplémentaires sur demande. Néanmoins, en raison du manque d'uniformisation et du caractère unique de chaque méthodologie, les informations fournies peuvent se révéler incomplètes, en particulier celles ayant trait à la description précise des variables employées pour le calcul des scores, le traitement des lacunes de données et la pondération des différentes variables et composantes des scores, ainsi que les méthodes de calcul.

Risque de calcul de l'indice

Les Compartiments suivent des indices qui sont déterminés, calculés et tenus à jour par les promoteurs de l'indice. Les promoteurs de l'indice peuvent être confrontés à des risques opérationnels qui peuvent générer des erreurs dans la détermination, la composition ou le calcul de l'indice pertinent suivi par les Compartiments, entraînant des pertes dans les investissements des Compartiments ou un écart par rapport à l'objectif de l'indice tel que décrit dans la méthodologie de l'indice et la description des Compartiments. Les risques opérationnels peuvent ne pas être identifiés immédiatement et durer un certain temps et, même en cas d'identification, il peut être impossible de recouvrer les pertes ou de donner droit au Compartiment à une compensation adéquate de la part du commanditaire de l'indice.

ANNEXE C – RÉCAPITULATIF DES ACTIONS ET DES FRAIS

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Amundi DAX III	Acc	Non	EUR	LU0252633754	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU2090062436	Distribution	0,07 %	0,08 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi LevDax Daily (2x) leveraged	Acc	Non	EUR	LU0252634307	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU2090062600	Distribution	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi S&P 500 II	Acc	Non	EUR	LU1135865084	Capitalisation	0,03 %	0,12 % ¹	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Dist	Non ¹	EUR	LU0496786574	Distribution	0,03 %	0,12 % ¹	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Dist	Non ¹	USD	LU0496786657	Distribution			Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU0959211326	Capitalisation	0,03 %	0,12 % ¹	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1302703878	Distribution	0,03 %	0,12 % ¹	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,03 %	0,12 % ¹	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1950341179	Distribution	0,03 %	0,12 % ¹	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU0959211243	Distribution	0,03 %	0,12 % ¹	EUR 100 000	EUR 100 000
	DI – USD	Non ¹	USD	TBD	Distribution	0,03 %	0,12 % ¹	Équivalent de 5 000 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	S-Acc	Non ¹	USD	TBD	Capitalisation	0,03 %	0,12 % ¹	Équivalent de 10 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
Amundi Australia	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU0496786905	Distribution	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000

1 Pour faciliter la prise en charge de certains frais du Compartiment (qui peuvent notamment inclure les commissions du Gestionnaire d'investissement, de l'Agent administratif et dépositaire et les frais de Licence d'indice), le Gestionnaire peut demander une contribution aux contreparties pour l'opération sur instruments dérivés et/ou les instruments impliqués pour réaliser la Réplication indirecte (plus de détails sont disponibles sur www.amundi.com et sur demande à l'adresse www.amundi.com - « Contact Us »).

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
S&P/ASX 200	Acc	Non	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi MSCI World Information Technology	UCITS ETF EUR Acc	Non1	EUR	LU0533033667	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Acc	Non1	USD	LU0533033741	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi MSCI World Health Care	UCITS ETF EUR Acc	Non1	EUR	LU0533033238	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Acc	Non1	USD	LU0533033311	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi MSCI World Financials	UCITS ETF EUR Acc	Non1	EUR	LU0533032859	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Acc	Non1	USD	LU0533033071	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll	Acc	Non	EUR	LU0832435464	Capitalisation	0,10 %	0,50 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,50 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi Global Equity Quality Income	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU0832436512	Distribution	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Acc	Non1	GBP	LU0855692520	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	S-Dist	Non1	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1040688639	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrat ESG	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU0959210278	Distribution	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Acc	Non	EUR	LU0959210781	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de	Équivalent de 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	Hedged Acc							100 000 EUR en CHF	EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Amundi MSCI Pacific Ex Japan	Acc	Non1	USD	LU1220245473	Capitalisation	0,07 %	0,23 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU1220245556	Distribution	0,07 %	0,23 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi Fed Funds US Dollar Cash	Acc	Non1	USD	LU1233598447	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	Non confirmé	Distribution	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	S-Dist	Non1	USD	Non confirmé	Distribution	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged S Dist	Oui	EUR	Non confirmé	Distribution	0,07 %	0,08 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi Pan Africa	Acc	Non	EUR	LU1287022708	Capitalisation	0,10 %	0,75 %	EUR 100 000	EUR 100 000
						0,10 %	0,75 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	USD	Non1	USD	N/A	Distribution				
Amundi Euro Government Bond 5-7Y	Acc	Non	EUR	LU1287023003	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de	Équivalent de 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	Hedged Dist							100 000 EUR en USD	EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Amundi Euro Government Bond 7-10Y	Acc	Non	EUR	LU1287023185	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Amundi Euro Government	Acc	Non	EUR	LU1287023268	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF	Non	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	EUR	EUR

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Bond 15+Y	Dist							100 000	100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond	Acc	Non	EUR	LU1287023342	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi S&P 500 Daily (-2x) Inverse	Acc	Non1	USD	LU1327051279	Capitalisation	0,10 %	0,50 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,50 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y	Acc	Non	EUR	LU1390062245	Capitalisation	0,10 %	0,15 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,15 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de	Équivalent de 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	Hedged Dist							100 000 EUR en USD	EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi US Inflation Expectations 10Y	Acc	Non1	USD	LU1390062831	Capitalisation	0,10 %	0,15 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,15 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Monthly UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi US	Acc	Non1	USD	LU1407887089	Capitalisation	0,02 %	0,05 %	Équivalent	Équivalent

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Treasury Bond 1-3Y								de 1 000 000 EUR en USD	de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU1407887162	Distribution	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF Euro Hedged Acc	Oui	EUR	LU1407887246	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF Euro Hedged Dist	Oui	EUR	LU1407887329	Distribution	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1407887592	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1407887675	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1407887758	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1407887832	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF MXN Hedged Acc	Oui	MXN	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN
	UCITS ETF MXN Hedged Dist	Oui	MXN	N/A	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN
	UCITS ETF HKD Hedged Acc	Oui	HKD	LU2338178218	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD
	UCITS ETF HKD Hedged Dist	Oui	HKD	LU2338178309	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD
Amundi US Treasury Bond 3-7Y	Acc	Non1	USD	LU1407888723	Capitalisation	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD

Compar-timent	Catégories d'actions	Cou-vertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU1407888996	Distribution	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF Euro Hedged Acc	Oui	EUR	LU1407889028	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF Euro Hedged Dist	Oui	EUR	LU1407889291	Distribution	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1407889374	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1407889457	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1407889531	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1407889614	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF MXN Hedged Acc	Oui	MXN	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN
	UCITS ETF MXN Hedged Dist	Oui	MXN	N/A	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN
Amundi US Treasury Bond Long Dated	Acc	Non1	USD	LU1407890547	Capitalisation	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU1407890620	Distribution	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1407890893	Capitalisation	0,02 %	0,13 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1407890976	Distribution	0,02 %	0,13 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1407891198	Capitalisation	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000	Équivalent de 1 000 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
								EUR en GBP	EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1407891271	Distribution	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1407891354	Capitalisation	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1407891438	Distribution	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF MXN Hedged Acc	Oui	MXN	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN
	UCITS ETF MXN Hedged Dist	Oui	MXN	N/A	Distribution	0,07 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN
	UCITS ETF HKD Hedged Acc	Oui	HKD	LU2338178648	Capitalisation	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD
	UCITS ETF HKD Hedged Dist	Oui	HKD	LU2338178721	Distribution	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD
Lyxor iBoxx £ Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF	Acc	Non1	GBP	LU1407891511	Capitalisation	0,04 %	0,05 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	Dist	Non1	GBP	LU1407891602	Distribution	0,04 %	0,05 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1407891784	Capitalisation	0,04 %	0,16 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1407891867	Distribution	0,04 %	0,16 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1407891941	Capitalisation	0,04 %	0,16 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD	Oui	USD	LU1407892089	Distribution	0,04 %	0,16 %	Équivalent de	Équivalent de 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	Hedged Dist							100 000 EUR en USD	EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1407892162	Capitalisation	0,04 %	0,16 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1407892246	Distribution	0,04 %	0,16 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	Acc	Non1	GBP	LU1407892329	Capitalisation	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF Dist	Non1	GBP	LU1407892592	Distribution	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1407892675	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1407892758	Distribution	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
Amundi UK Government Bond	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1407892832	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1407893053	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1407893053	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1407894028	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 E UR en CHF
Amundi UK Government Inflation- Linked Bond	Acc	Non1	GBP	LU1407893210	Capitalisation	0,03 %	0,04 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF Dist	Non1	GBP	LU1407893301	Distribution	0,03 %	0,04 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF	Oui	EUR	LU1407893483	Capitalisation	0,03 %	0,17 %	1 000 000	EUR

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	EUR Hedged Acc							EUR	100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1407893566	Distribution	0,03 %	0,17 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1407893640	Capitalisation	0,03 %	0,17 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1407893723	Distribution	0,03 %	0,17 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1407893996	Capitalisation	0,03 %	0,17 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1407894028	Distribution	0,03 %	0,17 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
Amundi US Treasury Bond 7-10Y	Acc	Non1	USD	LU1407887915	Capitalisation	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU1407888053	Distribution	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF Euro Hedged Acc	Oui	EUR	LU1407888137	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF Euro Hedged Dist	Oui	EUR	LU1407888210	Distribution	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1407888301	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1407888483	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1407888566	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1407888640	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
								CHF	CHF
	UCITS ETF MXN Hedged Acc	Oui	MXN	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN
	UCITS ETF MXN Hedged Dist	Oui	MXN	N/A	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN	Équivalent de 1 000 000 EUR en MXN
	UCITS ETF HKD Hedged Acc	Oui	HKD	LU2338178481	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD
	UCITS ETF HKD Hedged Dist	Oui	HKD	LU2338178564	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD	Équivalent de 1 000 000 EUR en HKD
	Acc	Non1	GBP	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF Dist	Non1	GBP	LU1439943090	Distribution	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,02 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
Amundi UK Government Bond 0-5Y	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,02 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
Amundi US TIPS Government	Acc	Non1	USD	LU1452600197	Capitalisation	0,04 %	0,11 %	Équivalent de 1 000 000	Équivalent de 1 000 000

Compar-timent	Catégories d'actions	Cou-vertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Inflation-Linked Bond								EUR en USD	EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU1452600270	Distribution	0,04 %	0,11 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1452600353	Capitalisation	0,04 %	0,21 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1452600437	Distribution	0,04 %	0,21 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1452600510	Capitalisation	0,04 %	0,21 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1452600601	Distribution	0,04 %	0,21 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1452600783	Capitalisation	0,04 %	0,21 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1452600866	Distribution	0,04 %	0,21 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
Amundi Global Aggregate Green Bond	Acc	Non	EUR	LU1563454310	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU1563454401	Distribution	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1563454823	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1563455044	Distribution	0,10 %	0,40 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1563455127	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1563455390	Distribution	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1563455556	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
UCITS ETF GBP	Oui	GBP	LU1563455630	Distribution	0,10 %	0,40 %	Équivalent de	Équivalent de 100 000	

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	Hedged Dist							100 000 EUR en GBP	EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1563455713	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1563455804	Distribution	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi FTSE Italia All Cap PIR 2020	Acc	Non	EUR	LU1605710802	Capitalisation	0,10 %	0,25 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU1605711362	Distribution	0,10 %	0,25 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1605711792	Capitalisation	0,10 %	0,45 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1605711958	Distribution	0,10 %	0,45 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1605712170	Capitalisation	0,10 %	0,45 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1605712337	Distribution	0,10 %	0,45 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1605712410	Capitalisation	0,10 %	0,45 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1605712766	Distribution	0,10 %	0,45 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi MSCI EMU	Acc	Non	EUR	LU1646361276	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU1646360971	Distribution	0,07 %	0,18 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1646361433	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1646361607	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en	Équivalent de 1 000 000 EUR en

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
								USD	USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1646361193	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1646361359	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1646361789	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1646361946	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
Amundi Euro Government Bond 1-3Y	Acc	Oui	EUR	LU1650487413	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Oui	EUR	LU1650487926	Distribution	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Non1	USD	LU1650487769	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Non1	USD	LU1650488148	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Non1	CHF	LU1650487843	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Non1	CHF	LU1650488221	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Non1	GBP	LU1650487686	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Non1	GBP	LU1650488064	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Amundi Euro Government Bond 3-5Y	Acc	Non	EUR	LU1650488494	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU1650488817	Distribution	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1650488650	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1650489112	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1650488734	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1650489203	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1650488577	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1650488908	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Amundi Euro Government Bond 10- 15Y	Acc	Non	EUR	LU1650489385	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU1650489898	Distribution	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1650489542	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1650490045	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1650489625	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1650490391	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1650489468	Capitalisation	0,07 %	0,195 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF	Oui	GBP	LU1650489971	Distribution	0,07 %	0,195 %	Équivalent	Équivalent

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	GBP Hedged Dist							de 100 000 EUR en GBP	de 100 000 EUR en GBP
Amundi Euro Government Bond II	Acc	Non	EUR	LU1650490474	Capitalisation	0,04 %	0,125 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU1650490805	Distribution	0,04 %	0,125 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1650490631	Capitalisation	0,04 %	0,225 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1650491019	Distribution	0,04 %	0,225 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1650490714	Capitalisation	0,04 %	0,225 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1650491100	Distribution	0,04 %	0,225 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1650490587	Capitalisation	0,04 %	0,225 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1650490987	Distribution	0,04 %	0,225 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Amundi Euro Government Inflation-Linked Bond	Acc	Non	EUR	LU1650491282	Capitalisation	0,04 %	0,16 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU1650491795	Distribution	0,04 %	0,16 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1650491449	Capitalisation	0,04 %	0,26 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1650491951	Distribution	0,04 %	0,26 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1650491522	Capitalisation	0,04 %	0,26 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1650492090	Distribution	0,04 %	0,26 %	Équivalent de 100 000 EUR en	Équivalent de 100 000 EUR en

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
								EUR en CHF	CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1650491365	Capitalisation	0,04 %	0,26 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1650491878	Distribution	0,04 %	0,26 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	Acc	Non1	GBP	LU1650492173	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF Dist	Non1	GBP	LU1650492256	Distribution	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1650492330	Capitalisation	0,07 %	0,23 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1650492413	Distribution	0,07 %	0,23 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1650492769	Capitalisation	0,07 %	0,23 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1650492843	Distribution	0,07 %	0,23 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1650492504	Capitalisation	0,07 %	0,23 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1650492686	Distribution	0,07 %	0,23 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi FTSE 100	Acc	Non1	USD	LU1781541179	Capitalisation	0,07 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
Amundi MSCI World V	Acc	Non1	JPY	LU1781541252	Capitalisation	0,07 %	0,05 %	la contre-valeur de EUR 1 000 000 en JPY	la contre-valeur de EUR 1 000 000 en JPY
Amundi MSCI Japan	UCITS ETF Dist	Non	JPY	LU2090063673	Distribution	0,07 %	0,05 %	la contre-valeur de	la contre-valeur

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
								EUR 1 000 000 en JPY	de EUR 1 000 000 en JPY
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,15 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,15 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1781541682	Capitalisation	0,07 %	0,15 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,15 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU2133056387	Distribution	0,07 %	0,15 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
Amundi MSCI Emerging Asia II	Acc	Non1	USD	LU1781541849	Capitalisation	0,07 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
AJ Bell Amundi UK Equity All Cap	Dist	Non1	GBP	LU1781541096	Distribution	0,02 %	0,02 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	S-Acc	Non	GBP	Non confirmé	Capitalisation	0,02 %	0,02 %	Le montant équivalent de 10 000 EUR en livre sterling	Le montant équivalent de 10 000 EUR en livre sterling
Lyxor Core US Equity (DR) UCITS ETF	Dist	Non1	USD	LU1781540957	Distribution	0,02 %	0,02 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged – Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,12 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,12 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,12 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Lyxor MSCI World ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF	Acc	Non1	USD	LU1792117779	Capitalisation	0,07 %	0,23 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,23 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,33 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,33 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi MSCI All Country World	UCITS ETF EUR Acc	Non1	EUR	LU1829220216	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Acc	Non1	USD	LU1829220133	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi Nasdaq-100	Acc	Non	EUR	LU1829221024	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
II	UCITS ETF EUR Dist	Non1	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1954152853	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi Euro Stoxx Banks	Acc	Non	EUR	LU1829219390	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition	Acc	Non	EUR	LU1829219127	Capitalisation	0,07 %	0,13 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,13 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF SEK Hedged Dist	Oui	SEK	N/A	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en SEK	Équivalent de 100 000 EUR en SEK
Amundi EUR Corporate Bond ex-	Acc	Non	EUR	LU1829218822	Capitalisation	0,07 %	0,13 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,13 %	EUR 100 000	EUR 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Financials ESG	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF SEK Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en SEK	Équivalent de 100 000 EUR en SEK
	UCITS ETF SEK Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,18 %	Équivalent de 100 000 EUR en SEK	Équivalent de 100 000 EUR en SEK
Amundi Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture	Acc	Non	EUR	LU1829218749	Capitalisation	0,10 %	0,25 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,25 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1900069219	Capitalisation	0,10 %	0,25 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,25 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,25 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi Euro Highest	Acc	Non	EUR	LU1829219556	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF	Non	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,095 %	EUR	EUR

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y	Dist							100 000	100 000
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y	Acc	Non	EUR	LU1829219713	Capitalisation	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,095 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi MSCI China	Acc	Non1	USD	LU1841731745	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	Amundi US	Acc	Non1	USD	LU1879532940	Capitalisation	0,10 %	0,25 %	Équivalent

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Inverse Inflation Expectations 10Y								de 100 000 EUR en USD	de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,25 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi MSCI China ESG Leaders Extra	Acc	Non	EUR	LU1900068914	Capitalisation	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	USD	Non1	USD	LU1900069136	Capitalisation	0,10 %	0,55 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi MSCI AC Asia Ex Japan	Acc	Non	EUR	LU1900068161	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,40 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi MSCI AC Asia Pacific Ex Japan	Acc	Non	EUR	LU1900068328	Capitalisation	0,10 %	0,50 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,50 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	USD	Non1	USD	LU1900068674	Capitalisation	0,10 %	0,50 %	Équivalent de 100,00 EUR en USD	Équivalent de 100,00 EUR en USD
Amundi MSCI Indonesia	Acc	Non	EUR	LU1900065811	Capitalisation	0,10 %	0,45 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,45 %	EUR 100 000	EUR 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened	Acc	Non	EUR	LU1900066033	Capitalisation	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU2090063327	Distribution	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi MSCI Brazil	Acc	Non	EUR	LU1900066207	Capitalisation	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi MSCI Eastern Europe Ex Russia	Acc	Non	EUR	LU1900066462	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,40 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi MSCI Korea	Acc	Non	EUR	LU1900066975	Capitalisation	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi MSCI Turkey	Acc	Non	EUR	LU1900067601	Capitalisation	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,55 %	EUR 100 000	EUR 100 000
Amundi Global Government Inflation-Linked Bond 1-10Y	Acc	Non1	USD	LU1910939765	Capitalisation	0,04 %	0,11 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU1910939849	Distribution	0,04 %	0,11 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1910939922	Capitalisation	0,04 %	0,16 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1910940185	Capitalisation	0,04 %	0,16 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1910940268	Distribution	0,10 %	0,10 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1910940342	Capitalisation	0,10 %	0,10 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1910940425	Distribution	0,10 %	0,10 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1910940698	Capitalisation	0,10 %	0,10 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
Amundi MSCI	Acc	Non	EUR	LU1940199711	Capitalisation	0,10 %	0,10 %	EUR 100 000	EUR 100 000

Compar-timent	Catégories d'actions	Cou-vertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Europe ESG Leaders	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,10 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y	Acc	Non	EUR	LU1981859819	Capitalisation	0,10 %	0,15 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,15 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de	Équivalent de 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	Hedged Acc							100 000 EUR en GBP	EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi MSCI Emerging Ex China	Acc	Non1	USD	LU2009202107	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU2009202289	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi Global Government Bond II	Acc	Non1	USD	N/A	Capitalisation	0,04 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,04 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,08 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,08 %	Équivalent	Équivalent

Compar-timent	Catégories d'actions	Cou-vertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	GBP Hedged Dist							de 1 000 000 EUR en GBP	de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
Lyxor Core Japanese Government Bond (DR) UCITS ETF	Acc	Non1	JPY	N/A	Capitalisation	0,03 %	0,04 %	la contreva-leur de EUR 1 000 000 en JPY	la contreva-leur de EUR 1 000 000 en JPY
	Dist	Non1	JPY	N/A	Distribution	0,03 %	0,04 %	la contreva-leur de EUR 1 000 000 en JPY	la contreva-leur de EUR 1 000 000 en JPY
	Monthly Hedged to EUR – Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	Monthly Hedged to EUR – Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,08 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	Monthly Hedged to USD – Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	Monthly Hedged to USD – Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	Monthly Hedged to GBP – Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	Monthly Hedged to GBP – Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,08 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	Monthly Hedged to CHF – Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %		Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	Monthly Hedged to CHF – Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,03 %	0,12 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Amundi US Curve steepening 2-10Y	Acc	Non1	USD	LU2018762653	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF	Acc	Non1	EUR	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,23 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Dist	Non1	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,23 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Monthly Hedged to USD – Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	Monthly Hedged to USD – Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	Monthly Hedged to CHF – Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	Monthly Hedged to CHF – Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	Monthly Hedged to GBP – Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	Monthly Hedged to GBP – Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,07 %	0,33 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	Monthly Hedged to EUR – Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,33 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Monthly Hedged to EUR – Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,07 %	0,33 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Acc	Non1	USD	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,02 %	0,05 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	Monthly Hedged to EUR - Acc	Oui	EUR	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,13 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	Monthly Hedged to EUR - Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,02 %	0,13 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	Daily Hedged to GBP – Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	Daily Hedged to GBP – Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	Monthly Hedged to CHF - Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	Monthly Hedged to CHF - Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,02 %	0,13 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition	Acc	Non	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,10 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,10 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU2195226068	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
								USD	
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,30 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF	Acc	Non1	EUR	N/A	Capitalisation	0,03 %	0,17 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Dist	Non1	EUR	N/A	Distribution	0,03 %	0,17 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Monthly Hedged to EUR – Acc	Oui	EUR	LU219888449	Capitalisation	0,03 %	0,37 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Monthly Hedged to EUR – Dist	Oui	EUR	N/A	Distribution	0,03 %	0,37 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	Monthly Hedged to USD – Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,03 %	0,37 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	Monthly Hedged to USD – Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,03 %	0,37 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	Monthly Hedged to CHF – Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,03 %	0,37 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	Monthly Hedged to CHF – Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,03 %	0,37 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	Monthly Hedged to GBP – Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,03 %	0,37 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
								GBP	
	Monthly Hedged to GBP– Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,03 %	0,37 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	S-Acc	Non1	EUR	LU2266995971	Capitalisation	0,03 %	0,27 %	10 000 000 EUR	1 000 000 EUR
Amundi Euro Government Green Bond	Acc	Non	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,10 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,10 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi Corporate Green Bond	Acc	Non	EUR	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,10 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	N/A	Distribution	0,10 %	0,10 %	EUR 100 000	EUR 100 000
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
								GBP	
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	N/A	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	N/A	Distribution	0,10 %	0,20 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi MSCI Emerging Markets II	Acc	Non1	USD	N/A	Capitalisation	0,07 %	0,07 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	N/A	Distribution	0,07 %	0,07 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi MSCI Europe Climate Action	UCITS ETF Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,04 %	0,14 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,04 %	0,14 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	Non confirmé	Capitalisation	0,04 %	0,19 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	Non confirmé	Distribution	0,04 %	0,19 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD	Équivalent de 1 000 000 EUR en USD
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	Non confirmé	Capitalisation	0,04 %	0,19 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	Non confirmé	Distribution	0,04 %	0,19 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF	Équivalent de 1 000 000 EUR en CHF
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	Non confirmé	Capitalisation	0,04 %	0,19 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	Non confirmé	Distribution	0,04 %	0,19 %	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP	Équivalent de 1 000 000 EUR en GBP

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,04 %	0,19 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	Non confirmé	Distribution	0,04 %	0,19 %	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Basic Resources	UCITS ETF - Acc	Non1	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF - Dist	Non1	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Banks	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Discretionary	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Industrials	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Insurance	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Healthcare	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Telecommunications	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Utilities	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,0 0 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,0	100 000,00

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Consumer Staples	Dist							0 EUR	EUR
Amundi STOXX Europe 600 Basic Materials	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,00 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,00 EUR	100 000,00 EUR
Amundi STOXX Europe 600 Technology	Acc	Non	EUR	Non confirmé	Capitalisation	0,10 %	0,20 %	100 000,00 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF Dist	Non	EUR	Non confirmé	Distribution	0,10 %	0,20 %	100 000,00 EUR	100 000,00 EUR
Amundi MSCI EMU Value Factor	UCITS ETF Dist	Non	EUR	LU1598690169	Distribution	0,10 %	0,30 %	100 000,00 EUR	100 000,00 EUR
	Acc	Non	EUR	LU1598690243	Capitalisation	0,10 %	0,30 %	100 000,00 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1598690326	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1598690599	Distribution	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1598690672	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1598690755	Distribution	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1598690839	Capitalisation	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1598690912	Distribution	0,10 %	0,40 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
Amundi Global Gender Equality	Acc	Non1	USD	LU1691909508	Capitalisation	0,10 %	0,10 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU1691910001	Distribution	0,10 %	0,10 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
	UCITS ETF USD Hedged Acc	Oui	USD	LU1691910340	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF USD Hedged Dist	Oui	USD	LU1691912718	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	Oui	GBP	LU1691915570	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	Oui	GBP	LU1692059493	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en GBP	Équivalent de 100 000 EUR en GBP
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	Oui	CHF	LU1692062794	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	Équivalent de 100 000 EUR en CHF
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	Oui	CHF	LU1692068486	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en CHF	EUR 100 000
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	Oui	EUR	LU1692072322	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	100 000,00 EUR	100 000,00 EUR
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	Oui	EUR	LU1692075770	Distribution	0,10 %	0,35 %	100 000,00 EUR	100 000,00 EUR
Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened	Acc	Non1	USD	LU2023678878	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000,00 EUR en USD	Équivalent de 100 000,00 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU2023678951	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000,00 EUR en USD	Équivalent de 100 000,00 EUR en USD
Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened	Acc	Non1	USD	LU2023678282	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU2023678365	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi MSCI	Acc	Non1	USD	LU2023679090	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	Équivalent	Équivalent de 100 000

Compartiment	Catégories d'actions	Couvertes	Devise	CODE ISIN	Capitalisation/ Distribution	Max. frais admin.	Max. frais de gestion	Montant minimum initial de souscription	Montant de souscription supplémentaire
Future Mobility ESG Screened								de 100 000 EUR en USD	EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU2023679173	Distribution	0,10 %	0,35 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD	Équivalent de 100 000 EUR en USD
Amundi MSCI Millennials ESG Screened	Acc	Non1	USD	LU2023678449	Capitalisation	0,10 %	0,35 %	0,45 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD
	UCITS ETF Dist	Non1	USD	LU2023678795	Distribution	0,10 %	0,35 %	0,45 %	Équivalent de 100 000 EUR en USD

ANNEXE D – TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION DES COMPARTIMENTS

Compartment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
Amundi DAX III	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
Amundi LevDax Daily (2x) leveraged	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
Amundi S&P 500 II	Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF Dist (EUR)	18 h 30	T
	UCITS ETF Dist (USD)	18 h 30	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T
	DI – USD	18 h 30	T
	S-Acc	18 h 30	T
Amundi Australia S&P/ASX 200	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	Acc	18 h 30	T+1
	Daily Hedged to USD – Acc	18 h 30	T+1
	Daily Hedged to EUR – Acc	18 h 30	T+1
	Daily Hedged to CHF – Acc	18 h 30	T+1
Amundi MSCI World Information Technology	UCITS ETF EUR Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI World Health Care	UCITS ETF EUR Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI World Financials	UCITS ETF EUR Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll	Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T
Amundi Global Equity Quality Income	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	Acc	18 h 30	T+1
	S-Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Dist	18 h 30	T+1

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF USD Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T+1
Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrat ESG	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T	
Amundi MSCI Pacific Ex Japan	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi Fed Funds US Dollar Cash	Acc	13 h 00	T
	UCITS ETF Dist	13 h 00	T
	S-Dist	13 h 00	T
	Monthly Hedged to EUR – S-Dist	13 h 00	T
Amundi Pan Africa	Acc	18 h 30	T
	USD	18 h 30	T+1
Amundi Euro Government Bond 5-7Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD HedgedAcc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T	
Amundi Euro Government Bond 7-10Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi Euro Government Bond 15+Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond	Acc	17 h 00	T
Amundi S&P 500 Daily (-2x) Inverse	Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T
Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi US Inflation Expectations 10Y	Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T
Amundi US Treasury Bond 1-3Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF Euro Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Euro Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF MXN Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF MXN Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF HKD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF HKD Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi US Treasury Bond 3-7Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF Euro Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Euro Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF MXN Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF MXN Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi US Treasury Bond Long Dated	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF MXN Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF MXN Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF HKD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF HKD Hedged Dist	17 h 00	T
Lyxor iBoxx £ Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to EUR – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to EUR – Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to USD – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to USD – Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to CHF – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to CHF – Dist	16 h 00	T
Amundi UK Government Bond	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	16 h 00	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	16 h 00	T
Amundi UK Government Inflation-Linked Bond	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	16 h 00	T
Amundi US Treasury Bond 7-10Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF Euro Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Euro Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF MXN Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF MXN Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF HKD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF HKD Hedged Dist	17 h 00	T
	Amundi UK Government Bond 0-5Y	Acc	16 h 00
UCITS ETF Dist		16 h 00	T
UCITS ETF EUR Hedged Acc		16 h 00	T
UCITS ETF EUR Hedged Dist		16 h 00	T
UCITS ETF USD Hedged Acc		16 h 00	T
UCITS ETF USD Hedged Dist		16 h 00	T
UCITS ETF CHF Hedged Acc		16 h 00	T
UCITS ETF CHF Hedged Dist		16 h 00	T
Amundi US TIPS Government Inflation-Linked Bond	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	17 h 00	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi Global Aggregate Green Bond	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T+1
UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T+1	
Amundi FTSE Italia All Cap PIR 2020	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi MSCI EMU	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi Euro Government Bond 1-3Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi Euro Government Bond 3-5Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi Euro Government Bond 10-15Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi Euro Government Bond II	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi Euro Government Inflation-Linked Bond	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi FTSE 100	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	17 h 00	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
Amundi MSCI World V	Acc	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Japan	UCITS ETF UCITS ETF Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged – Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged – Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged – Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged – Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Emerging Asia II	Acc	18 h 30	T+1
Lyxor Core UK Equity All Cap (DR) UCITS ETF	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	S-Acc	17 h 00	T
Lyxor Core US Equity (DR) UCITS ETF	Dist	18 h 30	T
	Daily Hedged to GBP – Acc	18 h 30	T
	Daily Hedged to EUR – Acc	18 h 30	T
	Daily Hedged to CHF – Acc	18 h 30	T
Lyxor MSCI World ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF	Acc	18 h 30	T+1
	Dist	18 h 30	T+1
	Monthly Hedged to USD – Acc	18 h 30	T+1
	Monthly Hedged to USD – Dist	18 h 30	T+1
	Monthly Hedged to GBP – Acc	18 h 30	T+1
	Monthly Hedged to GBP – Dist	18 h 30	T+1
	Monthly Hedged to EUR – Acc	18 h 30	T+1
	Monthly Hedged to EUR – Dist	18 h 30	T+1
	Monthly Hedged to CHF – Acc	18 h 30	T+1
	Monthly Hedged to CHF – Dist	18 h 30	T+1
Lyxor German Mid-Cap MDAX UCITS ETF	Acc	17 h 00	T
	Dist	17 h 00	T
Amundi MSCI All Country World	UCITS ETF EUR Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi Nasdaq-100 II	Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF EUR Dist	18 h 30	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF USD Dist	18 h 30	T
Amundi Euro Stoxx Banks	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged - Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged - Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF SEK Hedged Dist	16 h 00	T
Amundi EUR Corporate Bond ex-Financials ESG	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF SEK Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF SEK Hedged Dist	16 h 00	T
Amundi Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF EURO Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
Amundi MSCI China	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T+1
Amundi US Inverse Inflation Expectations 10Y	Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T
Amundi MSCI China ESG Leaders Extra	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	USD	18 h 30	T+1
Amundi MSCI AC Asia Ex Japan	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI AC Asia Pacific Ex Japan	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	USD	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Indonesia	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Brazil	Acc	18 h 30	T
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T
Amundi MSCI Eastern Europe Ex Russia	Acc	15 h 30	T
	UCITS ETF Dist	15 h 30	T
Amundi MSCI Korea	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Turkey	Acc	15 h 30	T
	UCITS ETF Dist	15 h 30	T
Amundi Global Government Inflation-	Acc	18 h 30	T+1

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
Linked Bond 1-10Y	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Europe ESG Leaders	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	16 h 00	T
Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Emerging Ex China	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi Global Government Bond II	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T+1

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 00	T+1
Lyxor Core Japanese Government Bond (DR) UCITS ETF	Acc	18 h 00	T+1
	Dist	18 h 00	T+1
	Monthly Hedged to EUR – Acc	18 h 00	T+1
	Monthly Hedged to EUR – Dist	18 h 00	T+1
	Monthly Hedged to USD – Acc	18 h 00	T+1
	Monthly Hedged to USD – Dist	18 h 00	T+1
	Monthly Hedged to GBP – Acc	18 h 00	T+1
	Monthly Hedged to GBP– Dist	18 h 00	T+1
	Monthly Hedged to CHF – Acc	18 h 00	T+1
	Monthly Hedged to CHF – Dist	18 h 00	T+1
Amundi US Curve steepening 2-10Y	Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF	Acc	16 h 00	T
	Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to USD – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to USD – Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to CHF – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to CHF – Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to GBP – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to GBP– Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to EUR – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to EUR – Dist	16 h 00	T
Lyxor Core US Government Bond (DR) UCITS ETF	Acc	16 h 00	T
	Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to EUR – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to EUR – Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to GBP – Acc	16 h 00	T
	Monthly Hedged to GBP– Dist	16 h 00	T
	Monthly Hedged to CHF – Acc	16 h 00	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	Monthly Hedged to CHF – Dist	16 h 00	T
	Acc	17 h 00	T
Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
		Acc	15 h 30
Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF	Dist	15 h 30	T
	Monthly Hedged to EUR – Acc	15 h 30	T
	Monthly Hedged to EUR – Dist	15 h 30	T
	Monthly Hedged to USD – Acc	15 h 30	T
	Monthly Hedged to USD – Dist	15 h 30	T
	Monthly Hedged to CHF – Acc	15 h 30	T
	Monthly Hedged to CHF – Dist	15 h 30	T
	Monthly Hedged to GBP – Acc	15 h 30	T
	Monthly Hedged to GBP – Dist	15 h 30	T
	S-Acc	15 h 30	T
		Acc	17 h 00
Amundi Euro Government Green Bond	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	17 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	17 h 00	T
		Acc	18 h 30
Amundi Corporate Green Bond	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Dist	18 h 30	T+1

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Emerging Markets II	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Europe Climate Action	UCITS ETF Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF USD Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	16 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Basic Resources	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Banks	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Discretionary	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Industrials	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Insurance	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Healthcare	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Telecommunications	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Utilities	Acc	16 h 00	T

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Staples	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Basic Materials	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi STOXX Europe 600 Technology	Acc	16 h 00	T
	UCITS ETF Dist	16 h 00	T
Amundi MSCI EMU Value Factor	UCITS ETF Dist	17 h 00	T
	Acc		
	UCITS ETF USD Hedged Acc		
	UCITS ETF USD Hedged Dist		
	UCITS ETF GBP Hedged Acc		
	UCITS ETF GBP Hedged Dist		
	UCITS ETF CHF Hedged Acc		
	UCITS ETF CHF Hedged Dist		
Amundi Global Gender Equality	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF USD Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF GBP Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF CHF Hedged Dist	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF EUR Hedged Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Future Mobility ESG	Acc	18 h 30	T+1

**ANNEXE D - TABLEAU RÉCAPITULATIF DU CALENDRIER DE NÉGOCIATION
DES COMPARTIMENTS**

MULTI UNITS LUXEMBOURG

Compartiment	Catégories d'actions	Heure limite de négociation (heure de Luxembourg)	Jour d'évaluation
Screened	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1
Amundi MSCI Millennials ESG Screened	Acc	18 h 30	T+1
	UCITS ETF Dist	18 h 30	T+1

ANNEXE E – OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET SWAPS DE RENDEMENT TOTAL

Sauf indication contraire dans le tableau ci-dessous, les Compartiments ne concluront pas d'opérations de prêt, d'emprunt, de mise en pension, de prise en pension ni d'achat-revente de titres.

Compartiments	Repo – attendu (%)	Repo – max. (%)	Rev Repo – attendu (%)	Rev Repo – max. (%)	Prêt de titres – attendu (%)	Prêt titres – max. (%)	Emprunt de titres – attendu (%)	Emprunt titres – max. (%)	TRS – attendu (%)	TRS – max. (%)
Amundi DAX III	0	0	0	0	20	25	0	0	0	0
Amundi LevDax Daily (2x) leveraged	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi S&P 500 II	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Australia S&P/ ASX 200	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI World Information Technology	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI World Health Care	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI World Financials	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Global Equity Quality Income	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrat ESG	0	0	0	0	20	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Pacific Ex Japan	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Fed Funds US Dollar Cash	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Pan Africa	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Euro Government Bond 5-7Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Euro Government Bond 7-10Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Euro Government Bond 15+Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi S&P 500 Daily (-2x) Inverse	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi US Inflation Expectations 10Y	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi US Treasury Bond 1-3Y	0	0	0	0	2	45	0	0	0	0
Amundi US Treasury Bond 3-7Y	0	0	0	0	2	45	0	0	0	0
Amundi US Treasury Bond Long Dated	0	0	0	0	2	45	0	0	0	0
Lyxor iBoxx £ Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi UK Government Bond	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi UK Government Inflation-Linked Bond	0	0	0	0	33,3	33,3	0	0	0	0
Amundi US Treasury Bond 7-10Y	0	0	0	0	2	45	0	0	0	0

Compartiments	Repo – attendu (%)	Repo – max. (%)	Rev Repo – attendu (%)	Rev Repo – max. (%)	Prêt de titres – attendu (%)	Prêt titres – max. (%)	Emprunt de titres – attendu (%)	Emprunt titres – max. (%)	TRS – attendu (%)	TRS – max. (%)
Amundi UK Government Bond 0-5Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi US TIPS Government Inflation-Linked Bond	0	0	0	0	41	45	0	0	0	0
Amundi Global Aggregate Green Bond	0	0	0	0	0	45	0	0	0	0
Amundi FTSE Italia All Cap PIR 2020	0	0	0	0	20	45	0	0	0	0
Amundi MSCI EMU	0	0	0	0	20	25	0	0	0	0
Amundi Euro Government Bond 1-3Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Euro Government Bond 3-5Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Euro Government Bond 10-15Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Euro Government Bond II	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Euro Government Inflation-Linked Bond	0	0	0	0	41	45	0	0	0	0
Amundi FTSE 100	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI World V	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Japan	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Emerging Asia II	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Lyxor Core UK Equity All Cap (DR) UCITS ETF	0	0	0	0	7	45	0	0	0	0
Lyxor Core US Equity (DR) UCITS ETF	0	0	0	0	16	45	0	0	0	0
Lyxor MSCI World ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF	0	0	0	0	16	45	0	0	0	0
Lyxor German Mid-Cap MDAX UCITS ETF	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI All Country World	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Nasdaq-100 II	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Euro Stoxx Banks	0	0	0	0	20	25	0	0	0	0
Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition	0	0	0	0	0	45	0	0	0	0
Amundi EUR Corporate Bond ex-Financials ESG	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y	0	0	0	0	10	45	0	0	0	0
Amundi MSCI China	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100

Compartiments	Repo – attendu (%)	Repo – max. (%)	Rev Repo – attendu (%)	Rev Repo – max. (%)	Prêt de titres – attendu (%)	Prêt titres – max. (%)	Emprunt de titres – attendu (%)	Emprunt titres – max. (%)	TRS – attendu (%)	TRS – max. (%)
Amundi US Inverse Inflation Expectations 10Y	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI China ESG Leaders Extra	0	0	0	0	2	45	0	0	0	0
Amundi MSCI AC Asia Ex Japan	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI AC Asia Pacific Ex Japan	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI Indonesia	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened	0	0	0	0	15	45	0	0	100	100
Amundi MSCI Brazil	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI Eastern Europe Ex Russia	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI Korea	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI Turkey	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Global Government Inflation-Linked Bond 1-10Y	0	0	0	0	41	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Europe ESG Leaders	0	0	0	0	14	45	0	0	0	0
Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y	0	0	0	0	0	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Emerging Ex China	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi Global Government Bond II	0	0	0	0	6	45	0	0	0	0
Lyxor Core Japanese Government Bond (DR) UCITS ETF	0	0	0	0	6	45	0	0	0	0
Amundi US Curve steepening 2-10Y	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Lyxor MSCI EM ESG Climate Transition CTB UCITS ETF	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF	0	0	0	0	14	45	0	0	0	0
Lyxor Core US Government Bond (DR) UCITS ETF	0	0	0	0	20	45	0	0	0	0
Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition	0	0	0	0	20	45	0	0	0	0
Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF	0	0	0	0	14	45	0	0	0	0
Amundi Euro Government Green Bond	0	0	0	0	0	45	0	0	0	0
Amundi Corporate Green Bond	0	0	0	0	0	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Emerging Markets II	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI Europe Climate Action	0	0	0	0	14	45	0	0	0	0
Amundi STOXX Europe 600 Basic Resources	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100

Compartiments	Repo – attendu (%)	Repo – max. (%)	Rev Repo – attendu (%)	Rev Repo – max. (%)	Prêt de titres – attendu (%)	Prêt titres – max. (%)	Emprunt de titres – attendu (%)	Emprunt titres – max. (%)	TRS – attendu (%)	TRS – max. (%)
Amundi STOXX Europe 600 Banks	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Discretionary	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Industrials	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Insurance	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Healthcare	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Telecommunications	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Utilities	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened	0	0	0	0	15	45	0	0	0	0
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Staples	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Basic Materials	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi STOXX Europe 600 Technology	0	0	0	0	0	0	0	0	100	100
Amundi MSCI EMU Value Factor	0	0	0	0	20	25	0	0	0	0
Amundi Global Gender Equality	0	0	0	0	15	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened	0	0	0	0	15	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened	0	0	0	0	15	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Future Mobility ESG Screened	0	0	0	0	15	45	0	0	0	0
Amundi MSCI Millennials ESG Screened	0	0	0	0	15	45	0	0	0	0

ANNEXE F – RÈGLEMENT SUR LES INDICES DE RÉFÉRENCE

À la date du présent Prospectus, les indices énumérés ci-dessous sont fournis par des administrateurs d'indice qui font usage des dispositions transitoires permises dans le cadre du Règlement (UE) 2016/1011 du Parlement européen et du Conseil du 8 juin 2016 concernant les indices utilisés comme indices de référence dans le cadre d'instruments et de contrats financiers ou pour mesurer la performance de fonds d'investissement (le « **Règlement sur les indices de référence** »). Par conséquent, ces indices ne figurent pas sur le registre public des administrateurs et des indices de référence tenu par l'AEMF conformément à l'article 36 dudit Règlement.

Compartiments	Administrateur d'indices de référence	Dénomination légale de l'administrateur d'indices de référence	Indice
Lyxor Core UK Equity All Cap (DR) UCITS ETF	Morningstar	Morningstar Inc.	Morningstar UK NR Index
Lyxor Core US Equity (DR) UCITS ETF	Morningstar	Morningstar Inc.	Morningstar US Large-Mid Cap NR Index
Amundi Nasdaq-100 II	Nasdaq OMX	The NASDAQ OMX Group, Inc.	NASDAQ-100 Notional Net Total Return index
Amundi MSCI China ESG Leaders Extra	MSCI	MSCI Limited	MSCI China Select ESG Rating and Trend Leaders Net Total Return Index
Amundi MSCI World Information Technology	MSCI	MSCI limited	MSCI World Information Technology Index – Net Total Return
Amundi MSCI World Health Care	MSCI	MSCI limited	MSCI World Health Care Index – Net Total Return
Amundi MSCI World Financials	MSCI	MSCI limited	MSCI World Financials Index – Net Total Return
Amundi MSCI Pacific Ex Japan	MSCI	MSCI limited	MSCI Pacific ex Japan Index – Net Total Return
Amundi Euro Government Bond 5-7Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 5-7 Year Bond Index
Amundi Euro Government Bond 7-10Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 7-10 Year Bond Index
Amundi Euro Government Bond 15+Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 15+ Year Bond Index
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond	FTSE	FTSE International Limited	FTSE MTS Highest Rated Macro-Weighted Government Bond (Mid Price) Index
Amundi US Treasury Bond 1-3Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays US Treasury 1-3 Year Index
Amundi US Treasury Bond 3-7Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays US Treasury 3-7 Year Index
Amundi US Treasury Bond Long Dated	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays US Long Treasury Index
Amundi UK Government Bond	FTSE	FTSE International Limited	FTSE Actuaries UK Conventional Gilts All Stocks index
Amundi UK Government Inflation-Linked Bond	FTSE	FTSE International Limited	FTSE Actuaries UK Index-Linked Gilts All Stocks
Amundi US Treasury Bond 7-10Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays US Treasury 7-10 Year Index
Amundi UK Government Bond 0-5Y	FTSE	FTSE International Limited	FTSE Actuaries UK Conventional Gilts Up To 5 Years index
Amundi US TIPS Government Inflation-Linked Bond	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Barclays US Government Inflation-Linked Bond Index
Amundi FTSE Italia All Cap PIR 2020	FTSE	FTSE International Limited	FTSE Italia PIR All Cap Net Tax Index

Amundi MSCI EMU	MSCI	MSCI Limited	MSCI EMU Net Return Index
Amundi Euro Government Bond 1-3Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 1-3 Year Bond
Amundi Euro Government Bond 3-5Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 3-5 Year Bond
Amundi Euro Government Bond 10-15Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 10-15 Year Bond Index
Amundi Euro Government Bond II	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn Bond Index
Amundi Euro Government Inflation-Linked Bond	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays Euro Government Inflation-Linked Index
Amundi FTSE 100	FTSE	FTSE International Limited	FTSE 100 Total Return Index
Amundi MSCI World V	MSCI	MSCI Limited	MSCI World Net Total Return USD Index
Amundi MSCI Japan	MSCI	MSCI Limited	MSCI Japan Net Total Return Index
Amundi MSCI Emerging Asia II	MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets Asia Net Total Return Index
Lyxor MSCI World ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF	MSCI	MSCI Limited	MSCI World Select ESG Rating and Trend Leaders Net Return USD Index
Amundi MSCI All Country World	MSCI	MSCI Limited	MSCI AC World Index (ACWI) Net Total Return index
Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg MSCI Euro Corporate Paris Aligned Green Tilted Index
Amundi EUR Corporate Bond ex-Financials ESG	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid ex Financial SRI Sustainable Index
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y	FTSE	FTSE International Limited	FTSE MTS Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y (Mid Price)
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y	FTSE	FTSE International Limited	FTSE MTS Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y (Mid Price)
Amundi MSCI China	MSCI	MSCI Limited	MSCI China Net Total Return USD Index
Amundi MSCI AC Asia Ex Japan	MSCI	MSCI Limited	MSCI AC Asia Ex Japan Net Total Return TM
Amundi MSCI AC Asia Pacific Ex Japan	MSCI	MSCI Limited	MSCI AC Asia Pacific-ex Japan Net Total Return
Amundi MSCI Indonesia	MSCI	MSCI Limited	MSCI Indonesia Net Total Return
Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened	MSCI	MSCI Limited	MSCI ACWI Semiconductors & Semiconductor Equipment ESG Filtered Net Total Return Index
Amundi MSCI Brazil	MSCI	MSCI Limited	MSCI Brazil Net Total Return Index
Amundi MSCI Eastern Europe Ex Russia	MSCI	MSCI Limited	MSCI EM Eastern Europe ex Russia Net Total Return
Amundi MSCI Korea	MSCI	MSCI Limited	MSCI Korea 20/35 Net Total Return Index
Amundi MSCI Turkey	MSCI	MSCI Limited	MSCI Turkey Net Total Return Index
Amundi Global Government Inflation-Linked Bond 1-10Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Barclays Global Inflation-Linked 1-10 Year Index
Amundi MSCI Europe ESG Leaders	MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe ESG Leaders Net Total Return Index
Amundi MSCI Emerging Ex China	MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets Ex China Net Total Return Index
Amundi Global Government Bond II	FTSE	FTSE International Limited	FTSE World Government Bond Index

Lyxor Core Japanese Government Bond (DR) UCITS ETF	FTSE	FTSE International Limited	FTSE Japanese Government Bond Index
Lyxor MSCI EM ESG Climate Transition CTB UCITS ETF	MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets ESG Climate Transition (EU CTB) Select Net Total Return Index
Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF	MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe ESG Climate Transition (EU CTB) Select Net Total Return Index
Amundi Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg Energy & Metals Equal-Weighted Total Return Index
Lyxor Core US Government Bond (DR) UCITS ETF	FTSE	FTSE International Limited	FTSE US Government Bond Index
Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y	Bloomberg Barclays	Bloomberg Index Services Limited	Bloomberg MSCI Global Green Bond 1-10 Year Index
Amundi MSCI Emerging Markets II	MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets Net Total Return Index
Amundi MSCI Europe Climate Action	MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Climate Action Net Total Return Index

A la date du Prospectus, les indices énumérés ci-dessous sont fournis par les administrateurs d'indice de référence qui figurent dans le registre visé par l'article 36 du Règlement sur les indices de référence en qualité d'administrateur agréé en vertu de l'article 34 dudit Règlement.

Compartiments	Administrateur d'indices de référence	Dénomination légale de l'administrateur d'indices de référence	Indice
Amundi S&P 500 II	S&P DJI	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P 500® Net Total Return
Amundi Australia S&P /ASX 200	S&P DJI	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P/ASX 200 Net Total Return Index
Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll	S&P DJI	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll Index
Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrat ESG	S&P DJI	S&P Dow Jones indices LLC	S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return Index
Amundi Fed Funds US Dollar Cash	Solactive	Solactive AG	Solactive Fed Funds Effective Rate Total Return
Amundi S&P 500 Daily (-2x) Inverse	S&P DJI	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P 500® 2X Inverse Daily Index
Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y	Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	Markit iBoxx EUR Breakeven Euro-Inflation France & Germany Index
Amundi US Inflation Expectations 10Y	Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	Markit iBoxx USD Breakeven 10-Year Inflation Index
Lyxor iBoxx £ Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF	Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	Markit iBoxx GBP Liquid Corporates Long Dated Mid Price TCA
Amundi Global Aggregate Green Bond	Solactive	Solactive AG	Solactive Green Bond EUR USD IG Index
Amundi Euro Stoxx Banks	Stoxx	STOXX Ltd.	Euro STOXX Banks
Amundi US Inverse Inflation Expectations 10Y	Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	iBoxx USD Inverse Breakeven 10-Year Inflation Index
Amundi US Curve steepening 2-10Y	Solactive	Solactive AG	Solactive USD Daily (x7) Steepener 2-10 Index
Amundi DAX III	Deutsche Börse	STOXX Ltd.	DAX®
Amundi LevDax Daily (2x) leveraged	Deutsche Börse	STOXX Ltd	LevDAX®
Amundi Global Equity Quality Income	SGI	Société Générale	SG Global Quality Income NTR
Amundi Pan Africa	SGI	Société Générale	SGI Pan Africa Net Total Return Index
Lyxor German Mid-Cap MDAX UCITS ETF	Deutsche Börse	STOXX Ltd	Mid Cap DAX index (MDAX)
Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition	S&P DJI	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index
Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF	S&P DJI	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index
Amundi Euro Government Green Bond	Solactive	Solactive AG	Solactive Euro Government Green Bond Index
Amundi Corporate Green Bond	Solactive	Solactive AG	Solactive EUR USD IG Corporate Green Bond TR Index
Amundi STOXX Europe 600 Basic Resources	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Basic Resources Index
Amundi STOXX Europe 600 Banks	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Banks Index

Compartiments	Administrateur d'indices de référence	Dénomination légale de l'administrateur d'indices de référence	Indice
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Discretionary	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Industry Consumer Discretionary 30-15 Index
Amundi STOXX Europe 600 Industrials	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Industry Industrials 30-15 Index
Amundi STOXX Europe 600 Insurance	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Insurance Index
Amundi STOXX Europe 600 Healthcare	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Health Care Index
Amundi STOXX Europe 600 Telecommunications	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Telecommunications Index
Amundi STOXX Europe 600 Utilities	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Utilities Index
Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Energy ESG+ Index
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Staples	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Industry Consumer Staples 30-15 Index
Amundi STOXX Europe 600 Basic Materials	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Industry Basic Materials 30-15 Index
Amundi STOXX Europe 600 Technology	Stoxx	STOXX Ltd.	STOXX Europe 600 Technology Index
Amundi MSCI EMU Value Factor	MSCI	MSCI Limited	MSCI EMU Value Index
Amundi Global Gender Equality	Solactive	Solactive AG	Solactive Equileap Global Gender Equality Index
Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened	MSCI	MSCI Limited	MSCI ACWI IMI Digital Economy & Metaverse ESG Filtered Index
Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened	MSCI	MSCI Limited	MSCI ACWI IMI Disruptive Technology ESG Filtered Index
Amundi MSCI Future Mobility ESG Screened	MSCI	MSCI Limited	MSCI ACWI IMI Future Mobility ESG Filtered Index
Amundi MSCI Millennials ESG Screened	MSCI	MSCI Limited	MSCI ACWI IMI Millennials ESG Filtered Index

Conformément au Règlement sur les indices de référence, la Société de gestion établit et tient à jour un plan d'urgence pour les indices utilisés comme indices de référence au sens dudit règlement.

ANNEXE G – RATIOS D'INVESTISSEMENT SPÉCIFIQUES

Loi allemande sur la fiscalité des fonds d'investissement (InvStG-E)

Au sens de la loi fiscale allemande sur les fonds d'investissement (« InvStG-E »), les Compartiments énumérés ci-dessous sont des fonds communs de placement qui répondent aux critères d'un « fonds actions ». À ce titre, le Compartiment détiendra des paniers de titres financiers éligibles au ratio d'investissement en actions au sens de la loi InvStG-E, qui représenteront un pourcentage minimum de son actif net (précisé dans le tableau ci-dessous) dans des circonstances normales de marché. Le Compartiment pourra procéder à des ajustements dudit panier, quotidiens si nécessaires, en vue de respecter ce ratio.

Compartiment	Ratio d'actions
Amundi DAX III	55 %
Amundi LevDax Daily (2x) leveraged	94 %
Amundi S&P 500 II	92 %
Amundi Australia S&P /ASX 200	94 %
Amundi MSCI World Information Technology	92 %
Amundi MSCI World Health Care	92 %
Amundi MSCI World Financials	92 %
Amundi S&P 500 VIX Futures Enhanced Roll	91 %
Amundi Global Equity Quality Income	92 %
Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrat ESG	55 %
Amundi MSCI Pacific Ex Japan	94 %
Amundi Pan Africa	94 %
Amundi S&P 500 Daily (-2x) Inverse	91 %
Amundi FTSE Italia All Cap PIR 2020	55 %
Amundi MSCI EMU	55 %
Amundi FTSE 100	94 %
Amundi MSCI World V	55 %
Amundi MSCI Japan	55 %
Amundi MSCI Emerging Asia II	92 %
Lyxor Core UK Equity All Cap (DR) UCITS ETF	55 %
Lyxor Core US Equity (DR) UCITS ETF	55 %
Lyxor MSCI World ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF	55 %
Lyxor German Mid-Cap MDAX UCITS ETF	94 %
Amundi MSCI All Country World	92 %
Amundi Nasdaq-100 II	92 %
Amundi Euro Stoxx Banks	55 %
Amundi Bloomberg Equal-weight Commodity ex-Agriculture	92 %
Amundi MSCI China	94 %
Amundi MSCI China ESG Leaders Extra	55 %

Compartiment	Ratio d'actions
Amundi MSCI AC Asia Ex Japan	94 %
Amundi MSCI AC Asia Pacific Ex Japan	94 %
Amundi MSCI Indonesia	94 %
Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened	60 %
Amundi MSCI Brazil	92 %
Amundi MSCI Eastern Europe Ex Russia	94 %
Amundi MSCI Korea	94 %
Amundi MSCI Turkey	94 %
Amundi MSCI Europe ESG Leaders	55 %
Amundi MSCI Emerging Ex China	92 %
Lyxor MSCI EM ESG Climate Transition CTB UCITS ETF	92 %
Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF	55 %
Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition	55 %
Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF	55 %
Amundi MSCI Europe Climate Action	60 %
Amundi STOXX Europe 600 Basic Resources	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Banks	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Discretionary	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Industrials	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Insurance	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Healthcare	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Telecommunications	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Utilities	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened	52 %
Amundi STOXX Europe 600 Consumer Staples	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Basic Materials	90 %
Amundi STOXX Europe 600 Technology	90 %

Compartiment	Ratio d'actions
Amundi MSCI EMU Value Factor	52 %
Amundi Global Gender Equality	52 %
Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened	52 %
Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened	52 %

Compartiment	Ratio d'actions
Amundi MSCI Future Mobility ESG Screened	52 %
Amundi MSCI Millennials ESG Screened	52 %

Au sens de la loi fiscale allemande sur les fonds d'investissement (« InvStG-E »), les Compartiments énumérés ci-dessous sont des fonds communs de placement dont le ratio d'investissement en actions est inférieur à 25 %.

Compartiment	Ratio d'actions
Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y	0 %
Amundi US Curve steepening 2-10Y	0 %
Amundi EUR Corporate Bond ex-Financials ESG	0 %
Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition	0 %
Amundi Euro Government Bond II	0 %
Amundi Euro Government Bond 1-3Y	0 %
Amundi Euro Government Bond 10-15Y	0 %
Amundi Euro Government Bond 15+Y	0 %
Amundi Euro Government Bond 3-5Y	0 %
Amundi Euro Government Bond 5-7Y	0 %
Amundi Euro Government Bond 7-10Y	0 %
Amundi Euro Government Inflation-Linked Bond	0 %
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond	0 %
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 1-3Y	0 %
Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 3-5Y	0 %
Amundi Global Aggregate Green Bond	0 %
Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y	0 %

Compartiment	Ratio d'actions
Amundi US Inverse Inflation Expectations 10Y	0 %
Amundi Corporate Green Bond	0 %
Amundi UK Government Bond	0 %
Amundi UK Government Bond 0-5Y	0 %
Amundi UK Government Inflation-Linked Bond	0 %
Amundi Global Government Inflation-Linked Bond 1-10Y	0 %
Amundi Fed Funds US Dollar Cash	0 %
Amundi US Inflation Expectations 10Y	0 %
Lyxor iBoxx GBP Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF	0 %
Amundi US TIPS Government Inflation-Linked Bond	0 %
Amundi US Treasury Bond 1-3Y	0 %
Amundi US Treasury Bond Long Dated	0 %
Lyxor iBoxx £ Liquid Corporates Long Dated UCITS ETF	0 %
Amundi US Treasury Bond 7-10Y	0 %
Amundi US Treasury Bond 3-7Y	0 %
Lyxor Core US Government Bond (DR) UCITS ETF	0 %
Lyxor Core Japanese Government Bond (DR) UCITS ETF	0 %
Amundi Global Government Bond II	0 %
Amundi Euro Government Green Bond	0 %

ANNEXE H – GLOSSAIRE

Dans le présent Prospectus, les termes et expressions suivants ont les significations ci-dessous :

<u>Agent Administratif</u>	signifie	Société Générale Luxembourg, agissant en qualité d'agent administratif de la Société, désigné par la Société de gestion.
<u>Action</u>	désigne	Action émise pour un Actionnaire dans un Compartiment.
<u>Actionnaire</u>	signifie	Une personne ayant investi dans la Société et inscrite en tant que détenteur d'Actions dans le registre des Actionnaires. Les institutions qui ne sont pas des Intermédiaires seront considérées comme des Actionnaires, sauf s'il s'agit d'établissements financiers situés dans un pays n'ayant pas mis en place de politique de lutte contre le blanchiment d'argent équivalente à celle en vigueur dans le Grand-Duché du Luxembourg, auquel cas elle devront fournir à l'Agent comptable des registres des preuves de l'identité des bénéficiaires effectifs des Actions.
<u>Agent comptable des registres</u>	signifie	Société Générale Luxembourg, agissant en qualité d'agent comptable des registres de la Société désigné par la Société de gestion.
<u>Agent social et Agent domiciliataire</u>	désigne	Arendt Services S.A, nommé Agent social et Agent domiciliataire par la Société et la Société de gestion
<u>Catégorie</u>	désigne	Catégories d'Actions (dont les caractéristiques sont établies dans le Tableau récapitulatif des actions émises par la Société).
<u>Commission de rachat initiale</u>	signifie	La commission de rachat à laquelle peuvent être assujettis les investisseurs souscrivant des Actions selon les modalités décrites dans la section « Investir dans la Société sur le marché primaire » et dans l'Annexe du Compartiment concerné. Aucune Commission de souscription initiale ne sera appliquée, sauf stipulation contraire dans l'annexe du Compartiment concerné ou décision contraire du Conseil d'administration.
<u>Commission de souscription initiale</u>	signifie	La commission de souscription à laquelle peuvent être assujettis les investisseurs souscrivant des Actions selon les modalités décrites dans la section « Investir dans la Société sur le marché primaire » et dans l'Annexe du Compartiment concerné. Aucune Commission de souscription initiale ne sera appliquée, sauf stipulation contraire dans l'annexe du Compartiment concerné ou décision contraire du Conseil d'administration.
<u>Compartiment</u>	désigne	Chacun des Compartiments de la Société correspondant à un portefeuille séparé d'actifs.
<u>Composante en numéraire</u>	signifie	La composante en numéraire du Fichier de composition du portefeuille. Celle-ci se compose de trois éléments, à savoir : (i) les dividendes accumulés attribuables aux Actionnaires du Compartiment (en général les dividendes et les intérêts obtenus moins les frais et les dépenses encourues depuis la distribution précédente ; (ii) les montants en espèces après arrondissement à la baisse du nombre d'Actions à délivrer, le montant en espèces détenu par le Compartiment ou les montants représentant la différence entre la pondération du Fichier de composition du portefeuille et celle du Compartiment ; et (iii) tout Coût de transactions sur le marché primaire à payer ;
<u>Coûts de transaction</u>	signifie	Tous les coûts et frais engagés dans le cadre de l'achat et de la vente de valeurs mobilières et d'instruments financiers en portefeuille, les frais et commissions de courtage, les intérêts ou taxes dus au titre des transactions d'achat et de vente, tel que décrit plus en détail dans l'annexe du Compartiment concerné.
<u>Coûts des transactions sur le marché primaire</u>	désigne	Dans le cadre de souscriptions ou de rachats sur le marché primaire, des coûts peuvent être facturés aux Participants autorisés, notamment tout ou partie des coûts de transaction ; les timbres et autres droits ; taxes ; charges gouvernementales ; courtages ; frais bancaires ; écarts de taux de change ; intérêts ; frais de conservation (liés aux ventes et aux achats) ; frais de transfert ; frais d'enregistrement et autres droits et charges, que ce soit dans le cadre de l'acquisition originale ou de l'augmentation des actifs du Compartiment concerné ou de la création, de l'émission, de la vente, de la conversion, du rachat d'Actions ou de la vente ou de l'achat d'investissements, ou dans tout autre cadre, qui seraient devenus, ou peuvent être, payables en raison ou au titre de la transaction ou de la négociation, avant ou au moment de celle-ci. Pour éviter toute ambiguïté, ces coûts peuvent inclure une provision pour couvrir la différence entre le prix auquel les actifs ont été évalués en vue de calculer la Valeur liquidative

		et le prix estimé, ou réel, auquel ces actifs sont achetés suite à une souscription, ou vendus suite à un rachat. Ils excluent toute commission due à des agents au titre des ventes ou achats d'Actions ou toute commission, taxe, frais et coût pouvant avoir été pris en compte lors de la vérification du calcul de la Valeur liquidative des Actions du Compartiment concerné.
<u>Crédit Agricole S.A. ou Crédit Agricole</u>	signifie	Une banque française, constituée en société à responsabilité limitée selon le droit français, dont le siège social est situé 12, place des États-Unis, 92127 Montrouge, ainsi que toutes ses filiales et/ou associés.
<u>CSSF</u>	désigne	Commission de Surveillance du Secteur Financier du Luxembourg qui est l'autorité de surveillance luxembourgeoise ou son successeur.
<u>Dépositaire</u>	désigne	Société Générale Luxembourg agissant en qualité Dépositaire et d'agent payeur de la Société, désignée par la Société.
<u>Devise de base</u>	désigne	La devise dans laquelle la Société est libellée.
<u>Devise de référence</u>	désigne	La devise dans laquelle les Compartiments et les Catégories d'Actions sont libellés.
<u>DIC</u>	désigne	Document d'informations clés et/ou « DICI » Document d'informations clés pour l'investisseur relatif(s) à chaque Compartiment ou Catégorie.
<u>Écart de suivi</u>	désigne	Avec une stratégie de l'indice, l'écart de suivi quantifie la volatilité de l'écart entre le rendement du Compartiment et celui de l'indice ou des indices suivis.
<u>EMTN</u>	signifie	Euro Medium Term Note
<u>Entité affiliée</u>	désigne	Désigne toute société qui contrôle une autre entité, est contrôlée par une autre entité, ou est soumise à un contrôle commun avec une autre entité, tel que cela est décrit dans le Bank Holding Company Act des États-Unis de 1956.
<u>Facteurs de durabilité</u>	désigne	Aux fins de l'art. 2(24) du SFDR, les questions environnementales, sociales et relatives aux employés, au respect des droits de l'homme, à la lutte contre la corruption et au trafic d'influence.
<u>Fichier de composition du portefeuille</u>	signifie	Le fichier détaillant les Investissements et/ou la Composante en numéraire pouvant être livrés par (a) les Participants autorisés en cas de souscriptions ou (b) la Société en cas de rachats.
<u>Frais de rachat</u>	signifie	tous frais ou toute commission autres que les Frais de transaction sur le marché primaire ou la Commission de souscription initiale, déterminés librement par la Société de gestion, pouvant s'appliquer aux Actions sur le Prix de rachat.
<u>Frais de souscription</u>	signifie	Tout frais ou toute commission autres que les Frais de transaction sur le marché primaire ou la Commission de souscription initiale, déterminés librement par la Société de gestion, pouvant s'appliquer aux Actions sur le Prix de souscription.
<u>Groupe Crédit Agricole,</u>	signifie	Crédit Agricole S.A. et toute filiale, Entité affiliée et/ou associée.
<u>Groupe Société Générale</u>	signifie	Société Générale S.A. et toute filiale, Entité affiliée et/ou associée.
<u>Indice de référence</u>	désigne	L'indice composé de valeurs mobilières ou d'autres actifs dont un Compartiment visera à répliquer la performance, conformément à son objectif et à ses politiques d'investissement, tels que précisés dans son Annexe respective. L'« Indice de référence » peut comprendre plusieurs indices et toute référence à l'« Indice de référence » doit être interprétée en ce sens.
<u>Insolvabilité</u>	désigne	Survient lorsque (i) une personne a été déclarée en liquidation ou en faillite par jugement ou décision effective ; (ii) un administrateur judiciaire ou équivalent a été nommé pour cette personne ou tout actif de cette personne, ou la personne est soumise à un ordre administratif, (iii) la personne passe des accords avec un ou plusieurs de ses créanciers ou est réputée incapable de rembourser ses dettes, (iv) la personne cesse ou menace de cesser ses activités commerciales ou la quasi-totalité de ses activités commerciales ou modifie ou menace de modifier la nature de ses activités, (v) un événement se produit concernant une personne dans toute juridiction ayant un impact similaire à celui des événements décrits aux points (i) à (iv) ci-dessus ou (vi) la Société pense, de bonne foi, que l'un quelconque des points ci-dessus peut se produire ;
<u>Instruments du marché monétaire</u>	désigne	Instruments normalement négociés sur le marché monétaire, qui sont liquides et dont la valeur peut être déterminée précisément à tout moment.

<u>Intermédiaire</u>	désigne	Tout agent commercial, distributeur agent de service et/ou prête-nom désignés pour proposer et vendre les Actions à des investisseurs et traiter les demandes de souscription, rachat, conversion ou transfert des Actionnaires.
<u>Investissement durable</u>	désigne	Aux fins de l'art. 2.(17) du SFDR (1) un investissement dans une activité économique qui contribue à l'atteinte d'un objectif environnemental, mesuré par exemple au moyen d'indicateurs clés en matière d'utilisation efficace des ressources concernant (i) l'utilisation d'énergie, (ii) les énergies renouvelables, (iii) les matières premières, (iv) l'eau et les terres, (v) la production de déchets et (vi) les émissions de gaz à effet de serre ou (vii) les effets sur la biodiversité et l'économie circulaire, ou (2) un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif social, en particulier un investissement qui contribue à la lutte contre les inégalités ou qui favorise la cohésion sociale, l'intégration sociale et les relations de travail, ou (3) un investissement dans le capital humain ou des communautés économiquement ou socialement défavorisées, pour autant que ces investissements ne causent de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles les investissements sont réalisés appliquent des pratiques de bonne gouvernance, en particulier en ce qui concerne des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel compétent et le respect des obligations fiscales. Des informations sur la méthodologie d'Amundi pour évaluer si un investissement est qualifié d'Investissement durable peuvent être trouvées dans la Déclaration réglementaire ESG d'Amundi sur www.amundi.com .
<u>Investissements</u>	signifie	Les valeurs mobilières et tous les autres actifs financiers liquides mentionnés dans le chapitre « Objectifs d'investissement/ Pouvoirs et restrictions en matière d'investissements ».
<u>Investisseurs institutionnels</u>	signifie	Un investisseur institutionnel au sens de l'article 174 (2) c) de la Loi de 2010, telle que modifiée en tant que de besoin.
<u>Jour d'évaluation</u>	signifie	Chaque Jour de négociation, en tenant compte du cours de clôture de l'indice ce Jour de négociation.
<u>Jour de négociation</u>	signifie	Le Jour ouvré au cours duquel les ordres de souscription, de rachat et de conversion doivent être reçus par l'Agent comptable des registres, agissant pour le compte de la Société.
<u>Jour ouvré</u>	signifie	Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le Lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir informé les Actionnaires).
<u>Loi Dodd-Frank</u>	désigne	La loi américaine Dodd Frank de réforme de Wall Street et de protection du consommateur (y compris, le cas échéant, les règlements d'application qui en découlent).
<u>Marché réglementé</u>	désigne	Un marché réglementé, qui opère régulièrement, qui est reconnu et ouvert au public
<u>Participant autorisé</u>	désigne	Un investisseur institutionnel, teneur de marché ou entité de courtage autorisé par la Société de gestion pour la souscription et/ou le rachat direct des Actions d'un Compartiment de la Société.
<u>Pays de l'OCDE</u>	désigne	Les pays membres, le cas échéant, de l'Organisation de coopération et de développement économiques tels que, à la date de ce Prospectus, l'Australie, l'Autriche, la Belgique, le Canada, la République tchèque, le Danemark, la Finlande, la France, l'Allemagne, la Grèce, la Hongrie, l'Islande, l'Irlande, l'Italie, le Japon, la Corée du Sud, le Luxembourg, le Mexique, les Pays-Bas, la Nouvelle-Zélande, la Norvège, la Pologne, le Portugal, la Slovaquie, l'Espagne, la Suède, la Suisse, la Turquie, le Royaume-Uni, les États-Unis.
<u>Produit du rachat</u>	signifie	Le Prix de rachat, minoré de tous les frais, coûts, débours ou impôts, comme décrit à la section
<u>Prospectus</u>	désigne	Le prospectus de la Société qui est réputé inclure le dernier rapport annuel disponible et, le cas échéant, le rapport semestriel non vérifié, s'il a été publié depuis le dernier rapport annuel. Ces rapports font partie intégrante du présent Prospectus.
<u>Règle Volcker</u>	désigne	Section 619 de la loi américaine Dodd Frank de réforme de Wall Street et de protection du consommateur (y compris, le cas échéant, les règlements d'application qui en découlent).

Règlement sur la publication d'informations ou SFDR	signifie	Le Règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers, tel que possiblement modifié, complété, consolidé, remplacé de quelque manière que ce soit ou autrement révisé.
Règlement Taxinomie ou RT	signifie	Le Règlement 2020/852 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur l'établissement d'un cadre visant à favoriser les investissements durables et modifiant le Règlement (UE) 2019/2088, le « Règlement sur la divulgation d'informations » ou « SFDR ».
<u>Ressortissant américain</u>	désigne	(A) Une « US Person », ou Ressortissant américain, au sens du Règlement S pris en application du U.S. Securities Act de 1933, tel qu'amendé ; ou (B) toute personne autre qu'une « personne qui n'est pas un ressortissant américain » définie au titre de la Règle CFTC 4.7(a)(iv) ; (C) Une « US Person », ou Ressortissant américain, au sens de la Section 7701 (a)(30) du code fiscal américain (Internal Revenue Code) de 1986, tel qu'amendé ;
<u>Ressortissant des États-Unis (US Person)</u>	désigne	(i) Toute personne physique résidant aux États-Unis ; (ii) toute société de personnes ou de capitaux organisé(e) ou constitué(e) selon la législation des États-Unis ; (iii) toute succession ayant pour exécuter ou administrateur un Ressortissant américain ; (iv) tout trust dont un administrateur est un Ressortissant américain ; (v) toute agence ou succursale d'une entité étrangère située aux États-Unis ; (vi) tout compte géré de manière non discrétionnaire ou compte assimilé (autre qu'une succession ou un trust) détenu par un courtier ou un fiduciaire au profit ou pour le compte d'un Ressortissant américain ; (vii) tout compte géré de manière non discrétionnaire ou compte assimilé (autre qu'une succession ou un trust) détenu par un courtier ou un fiduciaire organisé, constitué ou (dans le cas d'un particulier) résidant aux États-Unis ; (viii) toute société de personnes ou de capitaux si : <ul style="list-style-type: none"> • organisée ou constituée selon la législation d'une juridiction étrangère ; et • constituée par un Ressortissant américain principalement en vue d'investir dans des valeurs mobilières non enregistrées en vertu de la Loi de 1933, à moins qu'elle soit organisée ou constituée et détenue par des investisseurs accrédités (selon la définition de la règle 501(a) de la Loi de 1933), qui ne sont pas des personnes physiques, des successions ou des trusts. Cette définition exclut ce qui suit : (ix) tout compte géré de manière non discrétionnaire ou compte assimilé (autre qu'une succession ou un trust) tenu au profit ou pour le compte d'un non-Ressortissant américain par un courtier ou un fiduciaire professionnel organisé, constitué ou (dans le cas d'un particulier) résidant aux États-Unis ; (x) toute succession dont le fiduciaire professionnel agissant en qualité d'exécuter ou d'administrateur est un Ressortissant américain : <ul style="list-style-type: none"> • un exécuter ou administrateur de la succession qui n'est pas un Ressortissant américain jouit d'un pouvoir discrétionnaire exclusif ou partagé concernant l'investissement des actifs de la succession ; et • la succession est soumise à une législation étrangère ; (xi) toute succession dont le fiduciaire professionnel agissant en qualité d'administrateur (trustee) est un Ressortissant américain, si un administrateur qui n'est pas un Ressortissant américain jouit d'un pouvoir discrétionnaire exclusif ou partagé sur les actifs du trust et si aucun bénéficiaire du trust (et aucun constituant si le trust est révocable) n'est un Ressortissant américain ; (xii) un régime d'avantages sociaux des employés créé et géré conformément à la législation d'un pays autre que les États-Unis et suivant les usages et la documentation de ce pays ;

		<p>(xiii) toute agence ou succursale d'un Ressortissant américain située hors des États-Unis si :</p> <ul style="list-style-type: none"> • l'agence ou la succursale exerce ses activités pour des raisons commerciales valables ; et • l'agence ou la succursale exerce ses activités dans le secteur de l'assurance ou de la banque et est soumise à une réglementation effective en la matière dans le pays où elle est établie ; <p>(xiv) (xiv) Le Fonds monétaire International, la Banque Internationale pour la reconstruction et le développement, la Banque interaméricaine de développement, la Banque asiatique de développement, la Banque africaine de développement, les Nations Unies et leurs agences, affiliés et régimes de retraite ainsi que toutes autres organisations internationales similaires et leurs agences, affiliés et régimes de retraite.</p>
<u>Risques de durabilité :</u>	signifie	Aux fins de l'art. 2(22) du SFDR, un événement ou une situation dans le domaine environnemental, social ou de gouvernance qui, s'ils surviennent, pourraient avoir une incidence négative importante sur la valeur d'un investissement.
<u>RTS</u>	signifie	Un ensemble consolidé de normes techniques définies par le Parlement européen et le Conseil et publié le 6 avril 2022, qui fournissent des détails supplémentaires sur le contenu, la méthodologie et la présentation de certaines exigences de divulgation existantes en vertu du Règlement sur la publication d'informations et du Règlement Taxinomie.
<u>Société de Gestion</u>	signifie	Amundi Luxembourg S.A.
<u>Société Générale S.A. ou Société Générale</u>		Banque française à responsabilité limitée constituée selon le droit français, dont le siège social se situe 29, boulevard Haussmann, 75009 Paris, France.
<u>Statuts</u>	désigne	les statuts de la Société, dans leur version modifiée périodiquement.
<u>Valeur mobilière</u>	désigne	<p>(i) Actions et autres titres équivalents aux Actions</p> <p>(ii) Obligations et autres titres de créance</p> <p>Toutes autres valeurs mobilières négociables octroyant le droit d'acquies ces valeurs mobilières par souscription ou échange.</p>

ANNEXE I - PUBLICATIONS D'INFORMATIONS ESG DE CE PROSPECTUS

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Amundi S&P Eurozone Dividend Aristocrats ESG

Legal entity identifier:
549300JDVXJULA4ZPW45

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%



It promotes **Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 30% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index.

“Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

- ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The S&P DJI ESG Scores is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

S&P Dow Jones Indices (S&P DJI), in association with S&P Global Sustainable¹ Research, together provide Environmental, Social, and Governance (ESG) scores, (collectively known as S&P DJI ESG Scores), which measure companies' overall performance relating to financially material ESG factors. The S&P Global ESG scores dataset contains a total company-level ESG score for one financial year and consists of individual environmental (E), social (S), and governance (G) dimension scores, beneath which are (on average) more than 20 industry-specific criteria scores that can be used as signals of ESG risks and repercussions.

More detailed on S&P DJI ESG Scores can be found on the following link:

<https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf>

More precisely, S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return Index (the "Index") features the following characteristics:

a) Exclusions based on an ESG score: to be eligible, companies must have an S&P DJI ESG Score (as defined in the methodology of the Index). S&P DJI ESG Score methodology provides Environmental, Social, and Governance ("ESG") scores that robustly measure companies' financially material ESG factors. Through an analysis of ESG factors, the methodology aims to identify companies within the Eligible Universe that are well-equipped to recognize and respond to emerging sustainability opportunities and challenges in the global market. A full set of ESG indicators including but not limited to corporate governance, environmental reporting and labor practice indicators are calculated for each company covering various sustainability topics. Within each industry, each indicator has a different weight in the final ESG score calculation. For any information about S&P DJI ESG Score methodology, please refer to <https://www.spglobal.com/spdji/en/landing/investment-themes/esg-scores/>.

The lowest 25% companies ranked in term of S&P DJI ESG Score within the Eligible Universe are excluded from the Index.

Using such best-in-universe approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging.

The extra financial data coverage is at least 90% of the eligible equity securities of the Index.

b) Value-based exclusions from the following activities: controversial weapons, thermal coal and tobacco products .

c) Exclusions based on a United Nations Global Compact score: Arabesque's S-Ray universe is used to assess very poor performers in relation to the United Nations Global Compact ("UNGC") principles. Assessed companies are assigned a Global Compact (GC) Score (as defined in the methodology of the Index). The global S-Ray universe is ranked according to GC Score. All companies at or below the bottom 5% of the global S-Ray universe by GC Score rank are ineligible. Eligible Companies that do not have a GC Score are excluded. For more information regarding Arabesque's S-Ray, please refer to <https://arabesque.com/s-ray/>.

d) Additionally, the methodology of the Index monitors companies' sustainability performance on an ongoing basis, by assessing current controversies with potentially negative reputational or financial impacts. The latter includes issues such as economic crime or corruption, fraud, illegal commercial

practices, human rights issues, labour disputes, workplace safety, catastrophic accidents or environmental violations.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm (‘DNSH’), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company’s carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring

methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund tracks the performance of “S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return Index” (the "Index") denominated in Euros - while minimising the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return Index measures the performance of 40 high dividend-yielding and ESG-scoring companies from the S&P Europe BMI (the “Parent Index”) with an Eurozone country classification.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return Index (the "Index") features the following characteristics:

a) Exclusions based on an ESG score: to be eligible, companies must have an S&P DJI ESG Score (as defined in the methodology of the Index). S&P DJI ESG Score methodology provides Environmental, Social, and Governance (“ESG”) scores that robustly measure companies’ financially material ESG factors. Through an analysis of ESG factors, the methodology aims to identify companies within the Eligible Universe that are well-equipped to recognize and respond to emerging sustainability opportunities and challenges in the global market. A full set of ESG indicators including but not limited to corporate governance, environmental reporting and labor practice indicators are calculated for each company covering various sustainability topics. Within each industry, each indicator has a different weight in the final ESG score calculation. For any information about S&P DJI ESG Score methodology, please refer to <https://www.spglobal.com/spdji/en/landing/investment-themes/esg-scores/>.

The lowest 25% companies ranked in term of S&P DJI ESG Score within the Eligible Universe are excluded from the Index.

Using such best-in-universe approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging.

The extra financial data coverage is at least 90% of the eligible equity securities of the Index.

b) Value-based exclusions from the following activities: controversial weapons, thermal coal and tobacco products .

c) Exclusions based on a United Nations Global Compact score: Arabesque’s S-Ray universe is used to assess very poor performers in relation to the United Nations Global Compact (“UNGC”) principles. Assessed companies are assigned a Global Compact (GC) Score (as defined in the methodology of the Index). The global S-Ray universe is ranked according to GC Score. All companies at or below the bottom 5% of the global S-Ray universe by GC Score rank are ineligible. Eligible Companies that do not have a GC Score are excluded. For more information regarding Arabesque’s S-Ray, please refer to

<https://arabesque.com/s-ray/>.

d) Additionally, the methodology of the Index monitors companies' sustainability performance on an ongoing basis, by assessing current controversies with potentially negative reputational or financial impacts. The latter includes issues such as economic crime or corruption, fraud, illegal commercial practices, human rights issues, labour disputes, workplace safety, catastrophic accidents or environmental violations.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

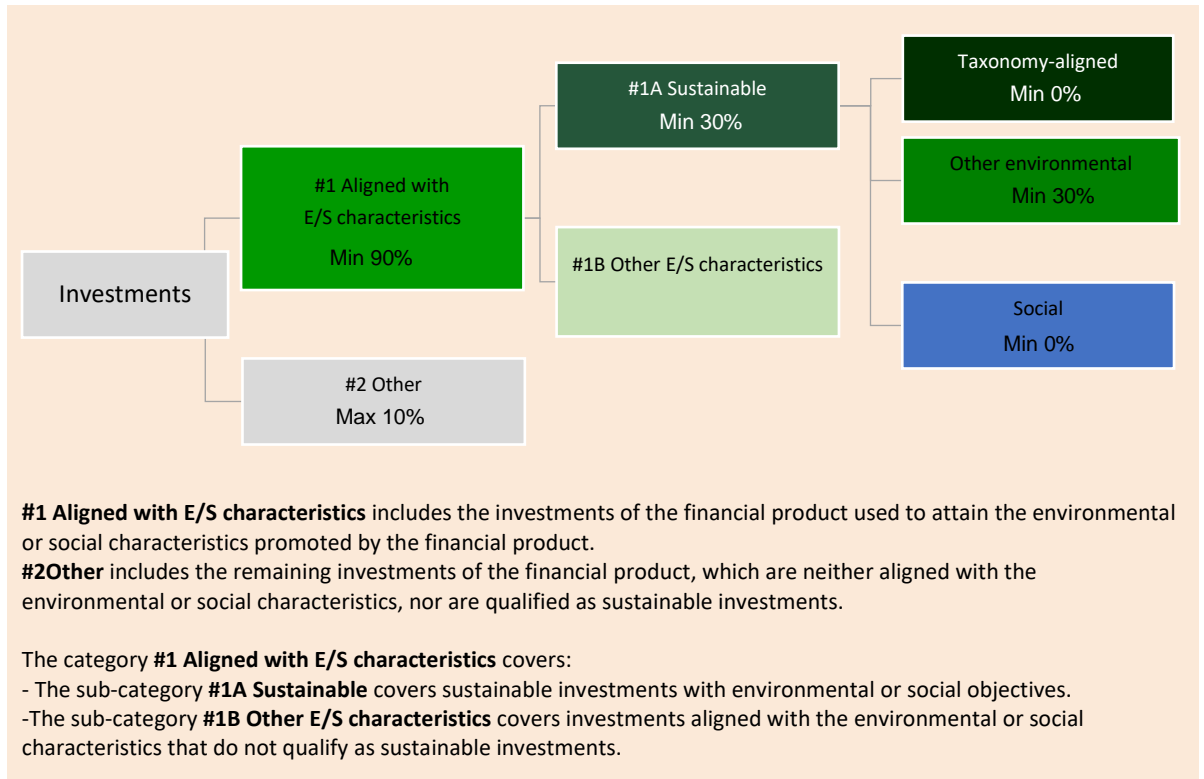
At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 30% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 30% (i) and may

change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

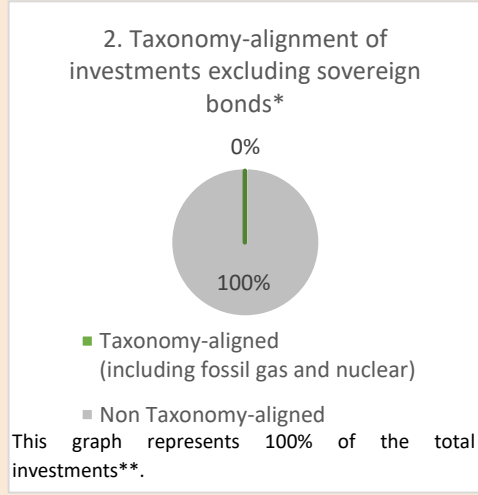
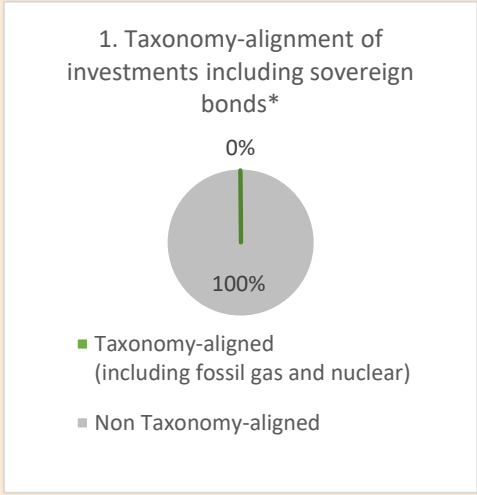
- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 30% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

● **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

S&P Euro ESG High Yield Dividend Aristocrats Net Total Return Index measures the performance of 40 high dividend-yielding and ESG-scoring companies from the S&P Europe BMI (the “Parent Index”) with an Eurozone country classification.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.spglobal.com/spdji/en/index-family/esg/core-esg/sp-esg/#overview>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Amundi Global Aggregate Green Bond

Legal entity identifier:
549300NMTL8UEBWJK406

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 60% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index composed of Green Bonds. To be eligible a bond must be considered as a “Green Bond” by the Climate Bonds Initiative.

Climate Bonds Initiative is an investor-focused- not-for-profit organization promoting large-scale investments that will deliver a global low carbon and climate resilient economy (more information is available on the website: <http://www.climatebonds.net/>). Climate Bonds Initiative has developed and implemented a set of criteria to define Green Bonds which are eligible for the Index.

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The use of proceeds of the bonds is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

More precisely, to be eligible for inclusion in the “Solactive Green Bond EUR USD IG Index” (the “Index”), a bond must be considered as a “Green Bond” by the Climate Bonds Initiative.

Climate Bonds Initiative is an investor-focused- not-for-profit organization promoting large-scale investments that will deliver a global low carbon and climate resilient economy (more information is available on the website: <http://www.climatebonds.net/>). Climate Bonds Initiative has developed and implemented the following set of criteria to define Green Bonds which are eligible for the Index:

i) Environmentally themed (self-labeled) bonds: to be eligible, green bonds must be publicly declared by their issuers as intended to be environmentally beneficial through labelling. Common eligible labels include, but are not limited to, ‘green’, ‘climate-awareness’, ‘climate’, ‘environmental’, ‘carbon’, ‘sustainability’ and ‘ESG’ (Environment, Social, and Governance). The issuer must use the label or description in a public document for the label to be valid (e.g., in a press release, in a statement, in the bond prospectus or supporting bond offering documents).

ii) Eligible bond structures, which include: Asset-linked structures or ‘use of proceeds’ bonds, whereby proceeds raised by bond sale are earmarked for eligible green projects; and Asset-backed structures consisting in (a) Project bonds, which are eligible if they are backed by a green project and the proceeds from bond sale are used solely to finance that same green project; and (b) Securitized bonds, which are eligible if proceeds go towards green projects or assets.

iii) Use of proceeds: issuers must commit to use proceeds from the bond sale in full (net of any bond arrangement fees) to finance eligible green projects or assets. For instance, bonds where more than 5% of the proceeds are used for ‘general corporate purposes’ or projects that are not defined as green, or bonds where proceeds are to be split across different projects (e.g., an ESG Bond with social projects and separate green projects) are not eligible for inclusion in the Index.

iv) Adherence with the “Climate Bonds Taxonomy”: proceeds of an eligible green bond must be used to finance eligible green assets or projects which are typically related to one of the following sectors (as described in the Climate Bonds Taxonomy):

- Renewable and Alternative Energy
- Energy efficiency
- Low-Carbon Transport
- Sustainable Water
- Waste, recycling and pollution
- Sustainable agriculture and forestry
- Climate resilient infrastructure and climate adaptation

As further described in the Climate Bonds Taxonomy, areas of the above sectors can be excluded (e.g., energy savings in fossil fuel extraction activities - for the energy efficiency category -, or the landfill without gas capture - for the waste category -) and related bonds are ineligible for inclusion in the Index.

More information can be found on the website: <http://www.climatebonds.net/> and <https://www.climatebonds.net/standard/taxonomy>.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that contributes to and has positive impacts on the energy and ecological transition by investing permanently at least 90% of the net asset value of the Sub-Fund in Green Bonds comprising the Index. To be eligible in the Index, Green Bonds shall meet the criteria defined by the Climate Bonds Initiative (as mentioned above).

The Sub-Fund has obtained the Greenfin label.

Through its methodology and the manner it is constructed (as described above), the Index is aligned with the sustainable investment objective of the Sub-Fund and differs from a broad market index. Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Risks Warning” of the prospectus.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Principal adverse impacts are the most significant

negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called “Community Involvement & Human Rights” which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and the downward evolution of the “Solactive Green Bond EUR USD IG Index” (the “Index”) denominated in Euros, in order to offer an exposure to the Green Bonds market - while minimising the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the “Tracking Error”).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

To be eligible for inclusion in the “Solactive Green Bond EUR USD IG Index” (the “Index”), a bond must be considered as a “Green Bond” by the Climate Bonds Initiative.

Climate Bonds Initiative is an investor-focused- not-for-profit organization promoting large-scale investments that will deliver a global low carbon and climate resilient economy (more information is available on the website: <http://www.climatebonds.net/>). Climate Bonds Initiative has developed and implemented the following set of criteria to define Green Bonds which are eligible for the Index:

i) Environmentally themed (self-labeled) bonds: to be eligible, green bonds must be publicly declared by their issuers as intended to be environmentally beneficial through labelling. Common eligible labels include, but are not limited to, ‘green’, ‘climate-awareness’, ‘climate’, ‘environmental’, ‘carbon’, ‘sustainability’ and ‘ESG’ (Environment, Social, and Governance). The issuer must use the label or description in a public document for the label to be valid (e.g., in a press release, in a statement, in the bond prospectus or supporting bond offering documents).

ii) Eligible bond structures, which include: Asset-linked structures or ‘use of proceeds’ bonds, whereby proceeds raised by bond sale are earmarked for eligible green projects; and Asset-backed structures consisting in (a) Project bonds, which are eligible if they are backed by a green project and the proceeds from bond sale are used solely to finance that same green project; and (b) Securitized bonds, which are eligible if proceeds go towards green projects or assets.

iii) Use of proceeds: issuers must commit to use proceeds from the bond sale in full (net of any bond arrangement fees) to finance eligible green projects or assets. For instance, bonds where more than

5% of the proceeds are used for 'general corporate purposes' or projects that are not defined as green, or bonds where proceeds are to be split across different projects (e.g., an ESG Bond with social projects and separate green projects) are not eligible for inclusion in the Index.

iv) Adherence with the "Climate Bonds Taxonomy": proceeds of an eligible green bond must be used to finance eligible green assets or projects which are typically related to one of the following sectors (as described in the Climate Bonds Taxonomy):

- Renewable and Alternative Energy
- Energy efficiency
- Low-Carbon Transport
- Sustainable Water
- Waste, recycling and pollution
- Sustainable agriculture and forestry
- Climate resilient infrastructure and climate adaptation

As further described in the Climate Bonds Taxonomy, areas of the above sectors can be excluded (e.g., energy savings in fossil fuel extraction activities - for the energy efficiency category -, or the landfill without gas capture - for the waste category -) and related bonds are ineligible for inclusion in the Index.

More information can be found on the website: <http://www.climatebonds.net/> and <https://www.climatebonds.net/standard/taxonomy>.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that contributes to and has positive impacts on the energy and ecological transition by investing permanently at least 90% of the net asset value of the Sub-Fund in Green Bonds comprising the Index. To be eligible in the Index, Green Bonds shall meet the criteria defined by the Climate Bonds Initiative (as mentioned above).

The Sub-Fund has obtained the Greenfin label.

Through its methodology and the manner it is constructed (as described above), the Index is aligned with the sustainable investment objective of the Sub-Fund and differs from a broad market index. Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section "Risks Warning" of the prospectus.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The

governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

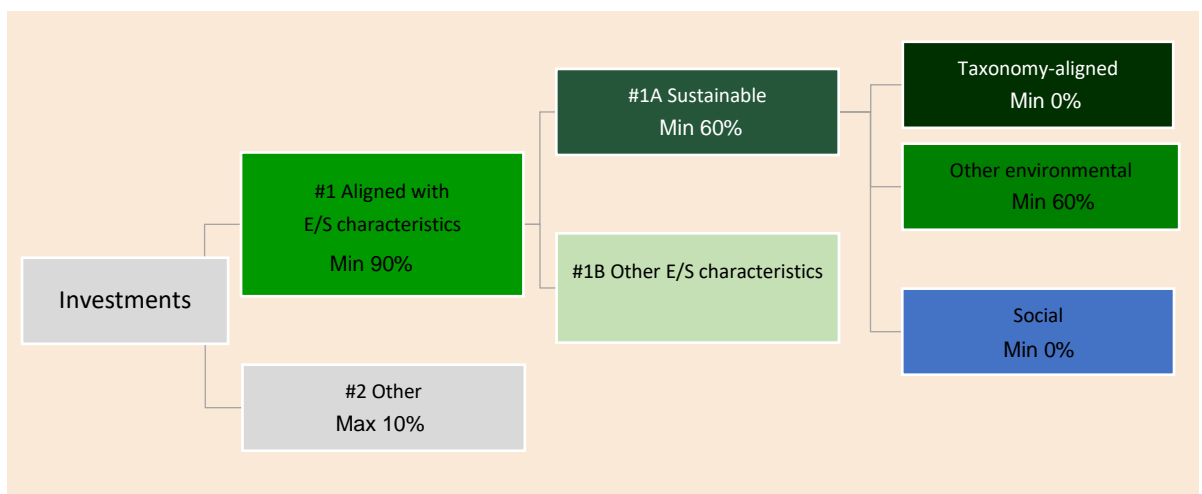
At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 60% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 60% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing



the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2Other includes the remaining investments of the financial product, which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

The category **#1 Aligned with E/S characteristics** covers:

- The sub-category **#1A Sustainable** covers sustainable investments with environmental or social objectives.
- The sub-category **#1B Other E/S characteristics** covers investments aligned with the environmental or social characteristics that do not qualify as sustainable investments.

● ***How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

● ***Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?***

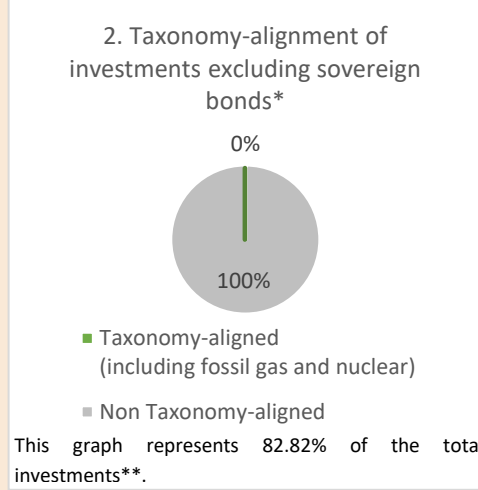
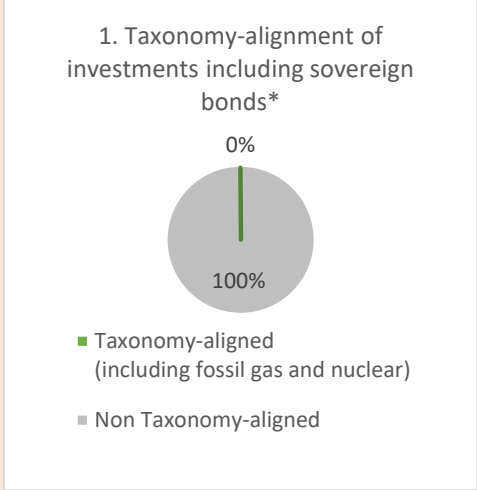
- Yes:
 - In fossil gas
 - In nuclear energy
- No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 60% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

● **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The “Solactive Green Bond EUR USD IG Index” (the “Index”) offers an exposure to the Green Bonds market.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.solactive.com/indices/>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:
Amundi EUR Corporate Bond PAB Net Zero Ambition

Legal entity identifier:
5493006LD608VBS18F78

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 20% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index that is meeting the minimum standards for EU Paris Aligned Benchmarks (EU PABs) under Regulation (EU) 2019/2089 amending Regulation (EU) 2016/1011. The law proposes the definitions of minimum standards for the methodology of any 'EU Paris Aligned' benchmark indices that would be aligned with the objectives of the Paris Agreement. The Index methodology align with certain criteria such as:

- A minimum reduction in Greenhouse Gas (GHG) emissions relative to Parent Index of 50%.
- A minimum self-decarbonization rate of GHG emissions in accordance with the trajectory implied by Intergovernmental Panel on Climate Change's (IPCC) most ambitious 1.5°C scenario, equating to at least 7% GHG intensity reduction on average per annum.

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The weighted average greenhouse gas (GHG) emissions is used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product. The GHG emissions are divided into Scope 1, Scope 2, and Scope 3 emissions. - Scope 1 emissions: those from sources owned or controlled by the company. - Scope 2 emissions: those caused by the generation of electricity purchased by the company. - Scope 3 emissions: include all other indirect emissions that occur in a company's value chain.

More precisely, Bloomberg MSCI Euro Corporate Paris Aligned Green Tilted Index ("The Index") intends to be representative of the Euro denominated investment grade corporate bond market while meeting and exceeding the minimum standards of the EU PAB. The index uses an optimization approach that aims to minimize the active total risk with respect to the Parent Index under constraints.

Among the universe of Euro denominated investment grade bonds issued by companies in developed markets (the "Universe"), the index methodology selects bonds using criteria such as but not limited to:

- 1) Minimum amount outstanding at bond level;
- 2) Remaining time to maturity;
- 3) Seniority of Debt: Senior and subordinated issues are included.
- 4) Issuers being attributed an "ESG Rating" (as defined by MSCI). MSCI ESG Rating provides an overall company ESG rating – a seven-point scale from 'AAA' to 'CCC'. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business. For the avoidance of doubt, companies with no ESG Ratings are excluded;

The application of eligibility criteria 1 to 4 leads to a narrowed investment universe (the "Eligible Universe");

The Eligible Universe is screened to exclude issuers:

- Involved in activities such as Alcohol, Gambling, Tobacco, Thermal Coal, Oil & Gas, Unconventional Oil & Gas, Power Generation, Nuclear Weapons, Controversial Weapons, Conventional Weapons, or Civilian Firearms activities based on revenue thresholds as defined in the methodology of the Index;
- Involved in a major ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
- Involved in environmental controversies (based on the MSCI Environmental Controversy Score);
- Identified as UNGC violator;
- With an "MSCI ESG Rating" lower than BB;

Once the Eligible Universe has been screened, an optimization process is then performed to select and weight each security in the Index in order to minimize the active total risk versus the Parent Index and comply with the EU PAB standards. The optimization process takes into account, among others, the

following constraints :

- Climate constraints such as but not limited to:
 - o A reduction in weighted average absolute GHG emissions relative to the Parent index at inception date;
 - o A minimal annual reduction in weighted average absolute GHG emissions relative to the Parent Index;
 - o A reduction in weighted average carbon intensity / sales relative to the Parent index at inception date;
 - o A minimal annual reduction in weighted average carbon intensity / sales relative to the Parent Index.
- Green bond constraints such as a minimum increase in Green Bond security weight relative to their weight in Parent Index.
- Investability constraints aiming at maintaining a similar risk profile with respect to the Parent Index (such as bond weight, yield and duration, sector, country of risk constraints) as defined in the methodology of the index.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi

Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN

Global Compact principles, coal and tobacco.

– *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called “Community Involvement & Human Rights” which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues

that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi's Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund tracks the performance of Bloomberg MSCI Euro Corporate Paris Aligned Green Tilted Index (the "Index"), and to minimize the tracking error between the net asset value of the sub-fund and the performance of the Index. Bloomberg MSCI Euro Corporate Paris Aligned Green Tilted Index is constructed from the Bloomberg Euro Corporate Index (the "Parent Index") and intends to be representative of the Euro denominated investment grade corporate bond market while meeting and exceeding the minimum standards of the EU PAB. The index uses an optimization approach that aims to minimize the active total risk with respect to the Parent Index under constraints.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

● **What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error. More precisely, Bloomberg MSCI Euro Corporate Paris Aligned Green Tilted Index intends to be representative of the Euro denominated investment grade corporate bond market while meeting and exceeding the minimum standards of the EU PAB. The Index uses an optimization approach that aims to minimize the active total risk with respect to the Parent Index under constraints.

Among the universe of Euro denominated investment grade bonds issued by companies in developed markets (the "Universe"), the index methodology selects bonds using criteria such as but not limited to:

- 1) Minimum amount outstanding at bond level;
- 2) Remaining time to maturity;
- 3) Seniority of Debt: Senior and subordinated issues are included.

4) Issuers being attributed an “ESG Rating” (as defined by MSCI). MSCI ESG Rating provides an overall company ESG rating – a seven-point scale from ‘AAA’ to ‘CCC’. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company’s resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company’s core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business. For the avoidance of doubt, companies with no ESG Ratings are excluded;

The application of eligibility criteria 1 to 4 leads to a narrowed investment universe (the “Eligible Universe”);

The Eligible Universe is screened to exclude issuers:

- Involved in activities such as Alcohol, Gambling, Tobacco, Thermal Coal, Oil & Gas, Unconventional Oil & Gas, Power Generation, Nuclear Weapons, Controversial Weapons, Conventional Weapons, or Civilian Firearms activities based on revenue thresholds as defined in the methodology of the Index;
- Involved in a major ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
- Involved in environmental controversies (based on the MSCI Environmental Controversy Score);
- Identified as UNGC violator;
- With an “MSCI ESG Rating” lower than BB;

Once the Eligible Universe has been screened, an optimization process is then performed to select and weight each security in the Index in order to minimize the active total risk versus the Parent Index and comply with the EU PAB standards. The optimization process takes into account, among others, the following constraints :

- Climate constraints such as but not limited to
 - o A reduction in weighted average absolute GHG emissions relative to the Parent index at inception date
 - o A minimal annual reduction in weighted average absolute GHG emissions relative to the Parent Index
 - o A reduction in weighted average carbon intensity / sales relative to the Parent index at inception date
 - o A minimal annual reduction in weighted average carbon intensity / sales relative to the Parent Index
- Green bond constraints such as a minimum increase in Green Bond security weight relative to their weight in Parent Index
- Investability constraints aiming at maintaining a similar risk profile with respect to the Parent Index (such as bond weight, yield and duration, sector, country of risk constraints) as defined in the methodology of the index.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



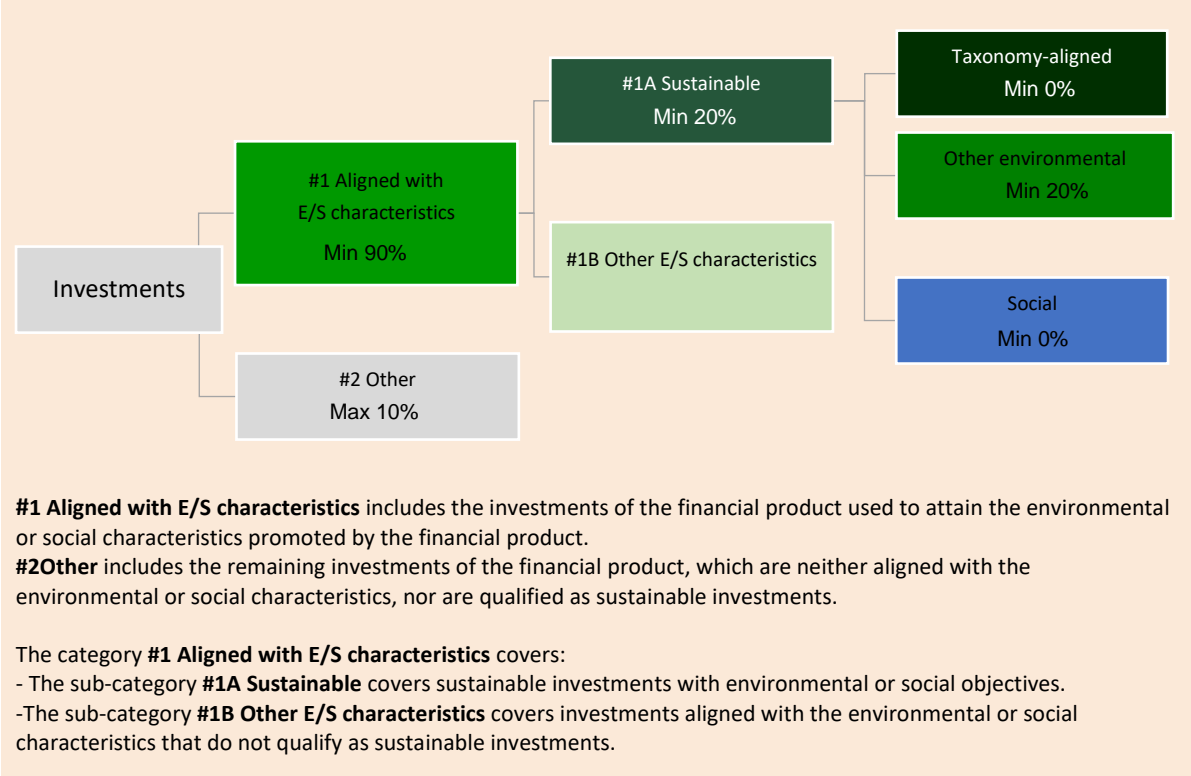
What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 20% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A). The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 20% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.

 **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

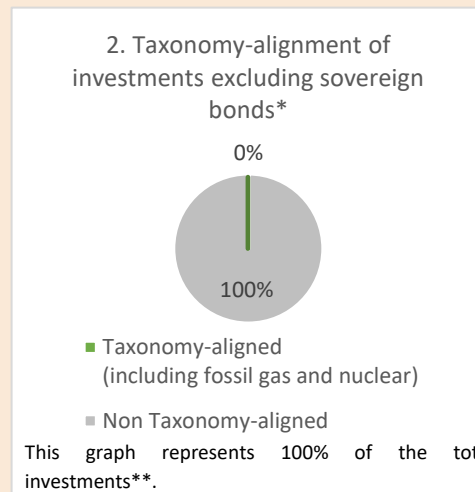
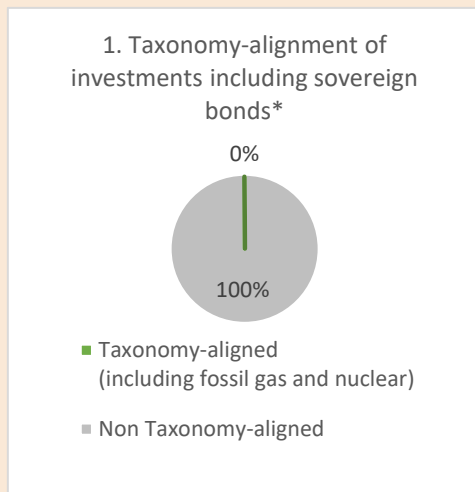
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.


The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

- **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 20% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Bloomberg MSCI Euro Corporate Paris Aligned Green Tilted Index is constructed from the Bloomberg Euro Corporate Index (the “Parent Index”) and intends to be representative of the Euro denominated investment grade corporate bond market while meeting and exceeding the minimum standards of the EU PAB. The index uses an optimization approach that aims to minimize the active total risk with respect to the Parent Index under constraints.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.bloomberg.com/>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Amundi EUR Corporate Bond Ex Financials ESG

Legal entity identifier:
54930010RGQHB1KEUC57

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 25% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index.

“Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The MSCI ESG Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

More detailed on MSCI ESG Rating can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>

More precisely, Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid ex Financial SRI Sustainable Index (the "Index") is a bond index, calculated, maintained and published by Bloomberg Barclays Indices.

Among the universe of Euro denominated investment grade bonds issued by non-financial companies in developed markets (the "Universe"), Bloomberg Barclays Indices selects bonds using rules on criteria such as but not limited to:

1) Minimum amount outstanding at bond level

2) Minimum bond outstanding at issuer level

3) Remaining time to maturity

4) Issuers being attributed an "ESG Rating" (as defined by MSCI). MSCI ESG Rating provides an overall company ESG rating – a seven-point scale from 'AAA' to 'CCC'. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business. For the avoidance of doubt, companies with no ESG Ratings are excluded;

The application of eligibility criteria 1 to 4 leads to a narrowed investment universe (the "Eligible Universe");

5) The Eligible Universe is screened to exclude issuers:

- Involved in activities such as Alcohol, Tobacco, Gambling, Adult Entertainment, Genetically Modified organisms (GMO), Nuclear Power, Civilian Firearms, Military Weapons (as per the standard Bloomberg Barclays MSCI SRI screen), Thermal Coal, Generation of Thermal Coal, or Unconventional Oil and Gas;

- Involved in a major ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);

- With an "ESG Rating" lower than BBB

The Index uses a "Best-in-class" approach, i.e., an approach where leading or best-performing

investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the Eligible Universe (expressed in number of issuers).

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm (‘DNSH’), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies)

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and

employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise,

analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and the downward evolution of the Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid ex Financial SRI Sustainable Index (the “Index”) denominated in Euros and representative of the performance of the non-financial investment grade corporate bond market denominated in Euros, while minimizing the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the “Tracking Error”).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid ex Financial SRI Sustainable Index (the “Index”) is a bond index, calculated, maintained and published by Bloomberg Barclays Indices.

Among the universe of Euro denominated investment grade bonds issued by non-financial companies in developed markets (the “Universe”), Bloomberg Barclays Indices selects bonds using rules on criteria such as but not limited to:

1) Minimum amount outstanding at bond level

2) Minimum bond outstanding at issuer level

3) Remaining time to maturity

4) Issuers being attributed an “ESG Rating” (as defined by MSCI). MSCI ESG Rating provides an overall company ESG rating – a seven-point scale from ‘AAA’ to ‘CCC’. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company’s resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company’s core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business. For the avoidance of doubt, companies with no ESG Ratings are excluded;

The application of eligibility criteria 1 to 4 leads to a narrowed investment universe (the “Eligible Universe”);

5) The Eligible Universe is screened to exclude issuers:

- Involved in activities such as Alcohol, Tobacco, Gambling, Adult Entertainment, Genetically Modified organisms (GMO), Nuclear Power, Civilian Firearms, Military Weapons (as per the standard Bloomberg Barclays MSCI SRI screen), Thermal Coal, Generation of Thermal Coal, or Unconventional Oil and Gas;
- Involved in a major ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
- With an “ESG Rating” lower than BBB

The Index uses a “Best-in-class” approach, i.e., an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the Eligible Universe (expressed in number of issuers).

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi’s ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer’s ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer’s value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders’ rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi’s ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 25% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

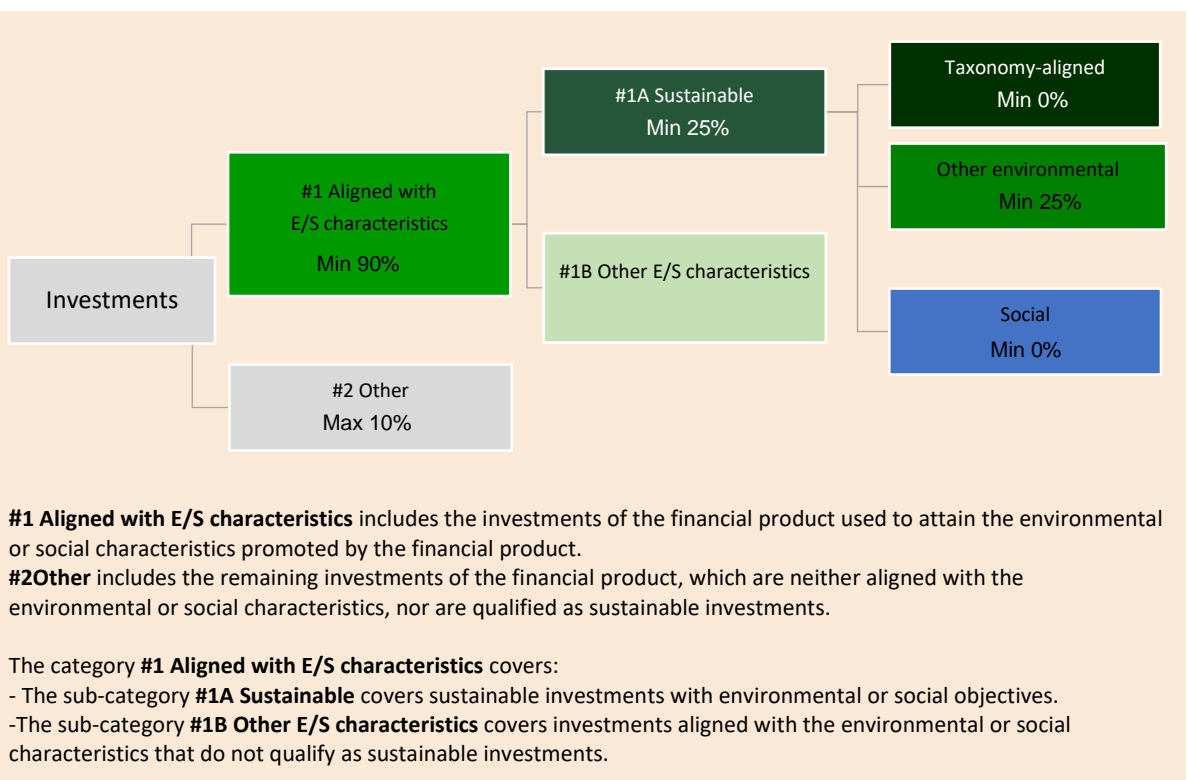
The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 25% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

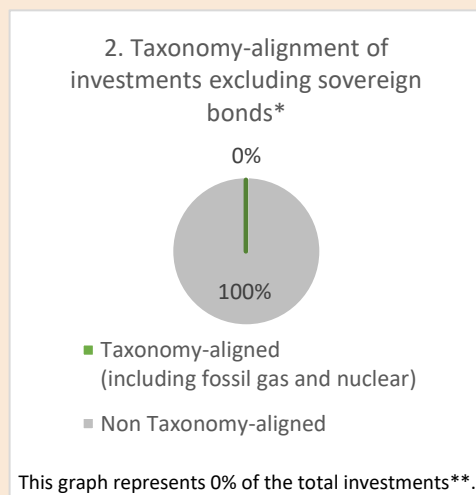
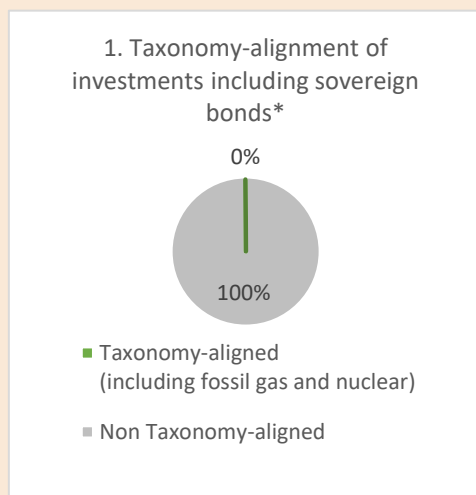
- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.




* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 25% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

● **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The index is representative of the performance of EUR denominated, investment grade corporate bonds issued by European and non-European corporates, with maturities of at least 1 year. The index only includes issuers with an MSCI ESG Rating of BBB or higher, and negatively screens issuers involved in certain values-based business involvement criteria, including activities related to controversial military weapons, and those with a “red” MSCI ESG Controversy Score.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Lyxor MSCI China ESG Leaders Extra (DR) UCITS ETF

Legal entity identifier:
549300E7C8KZ5P6BZI39

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 10% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index.

“Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The MSCI ESG Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

More detailed on MSCI ESG Rating can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>

More precisely, MSCI China Select ESG Rating and Trend Leaders Net Total Return Index (the "Index") features the following characteristics:

- a) Same investment universe of securities as the MSCI China Index (the "Parent Index");
- b) ESG value-based exclusions from the following activities: alcohol, gambling, tobacco, civilian firearms, nuclear power, adult entertainment, genetically modified organisms, conventional and controversial weapons;
- c) Climate change-based exclusions from the following activities: fossil fuel reserves ownership, extraction and production of thermal coal/unconventional oil and gas/conventional oil and gas/uranium mining, fossil fuel/nuclear/thermal coal-based power generation, oil and gas downstream activities;
- d) Exclusion of companies involved in a major ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
- e) Companies are ranked based on their ESG ratings and trends (yearly improvement or degradation of ESG ratings). MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics. The Index is constructed using a "Best-in-class" approach: best ranked companies in each sector (in accordance with the Global Industry Classification Standard (GICS)) are selected to construct the Index. Filters are less restrictive for stocks already in the Index in order to reduce the turnover on a rebalancing date. "Best-in-class" is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers). The extra financial data coverage is above 90% of the eligible securities of the Index.

f) The Index is free float-adjusted market capitalization weighted and the cumulated free-float adjusted market capitalization by GICS sector is overall proportional to the one of the Parent Index;

g) An iterative downweighting ensures that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the Parent Index.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm (‘DNSH’), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters,

investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund tracks both the upward and the downward evolution of the MSCI China Select ESG Rating and Trend Leaders Net Total Return Index (the "Index")denominated in US Dollars, and representative of the performance of large and mid cap stocks, across the Chinese economy, issued by companies with robust Environmental, Social and Governance (ESG) ratings, while minimizing the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

● ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

MSCI China Select ESG Rating and Trend Leaders Net Total Return Index (the "Index") features the following characteristics:

- a) Same investment universe of securities as the MSCI China Index (the "Parent Index");
- b) ESG value-based exclusions from the following activities: alcohol, gambling, tobacco, civilian firearms, nuclear power, adult entertainment, genetically modified organisms, conventional and controversial weapons;
- c) Climate change-based exclusions from the following activities: fossil fuel reserves ownership, extraction and production of thermal coal/unconventional oil and gas/conventional oil and gas/uranium mining, fossil fuel/nuclear/thermal coal-based power generation, oil and gas downstream activities;
- d) Exclusion of companies involved in a major ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
- e) Companies are ranked based on their ESG ratings and trends (yearly improvement or degradation of ESG ratings). MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

The Index is constructed using a "Best-in-class" approach: best ranked companies in each sector (in accordance with the Global Industry Classification Standard (GICS)) are selected to construct the Index. Filters are less restrictive for stocks already in the Index in order to reduce the turnover on a rebalancing date.

"Best-in-class" is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class.

Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly

engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

The extra financial data coverage is above 90% of the eligible securities of the Index.

f) The Index is free float-adjusted market capitalization weighted and the cumulated free-float adjusted market capitalization by GICS sector is overall proportional to the one of the Parent Index;

g) An iterative downweighting ensures that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the Parent Index.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 10% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

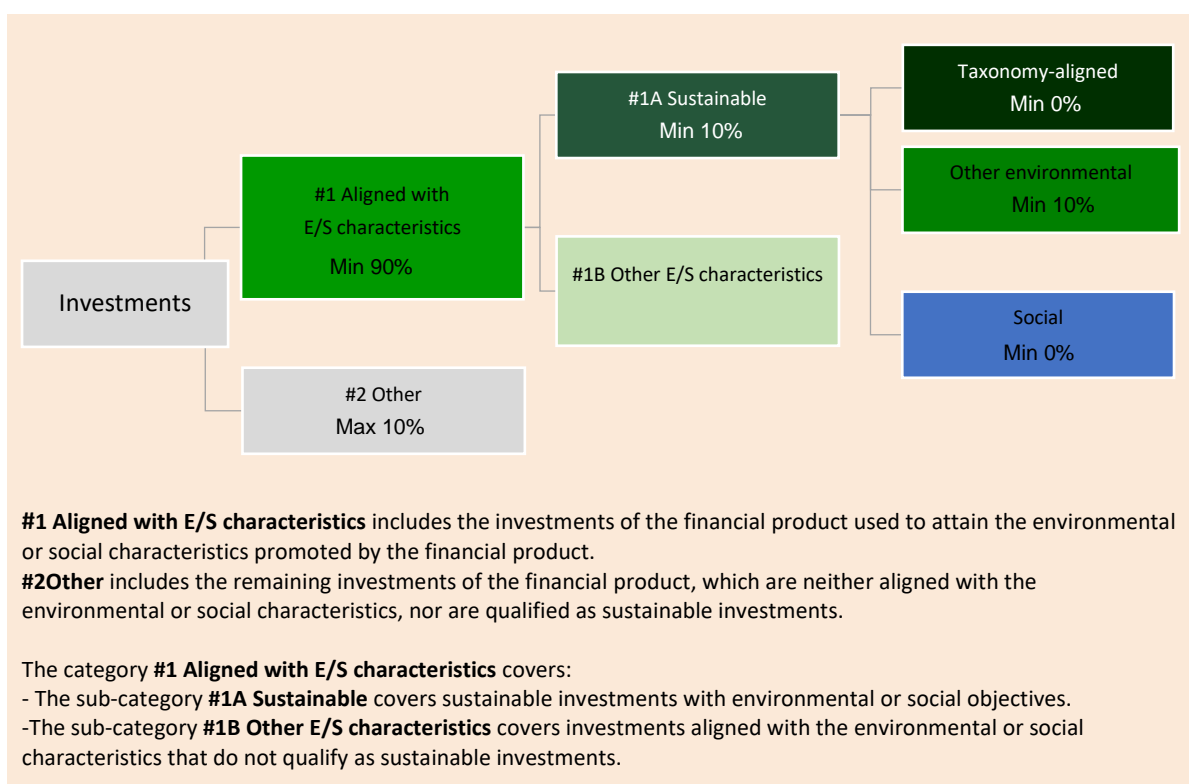
The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 10% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund currently has no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy. The Sub-Fund does not commit to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment

strategy, it may invest in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

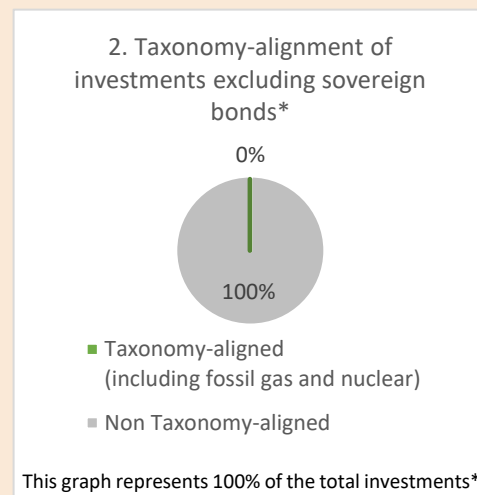
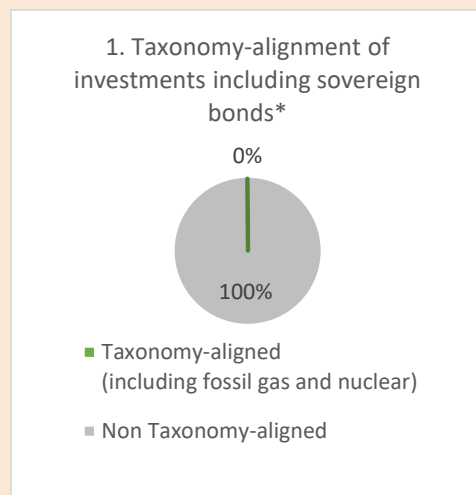
- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

- **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

- **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 10% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.

- **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.

- **What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?**

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



- **Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?**

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The MSCI China Select ESG Rating and Trend Leaders Net Total Return Index (the "Index") is denominated in US Dollars, and representative of the performance of large and mid cap stocks, across the Chinese economy, issued by companies with robust Environmental, Social and Governance (ESG) ratings

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.msci.com/index-methodology>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened

Legal entity identifier:
549300PEVY81KWEMRO55

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 10,00 % of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index.

“Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe.

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The MSCI ESG Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

More detailed on MSCI ESG Rating can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>

More precisely, MSCI ACWI Semiconductors & Semiconductor Equipment ESG Filtered Net Total Return Index (the "Index") features the following characteristics:

a) The Index is constructed by selecting stocks from the Parent Index including large and mid cap stocks across developed and emerging countries.

b) An ESG negative screening is performed on the Parent Index securities as defined in the methodology in order to exclude:

- Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of United Nations Global Compact (UNGC) principles;

- Companies involved in very severe business controversies as defined by the MSCI ESG Controversies;

- Companies with no "ESG Rating" or Controversy Score (as defined by MSCI).

Additionally, an "emerging markets securities filter" is applied to finalize the "Eligible Universe".

c) The selected universe ("Selected Universe") is constructed based on the Eligible Universe by using a "Best-in-class" approach: bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the Eligible Universe. "Best-in-class" approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers). Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section "Principal risks" of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Index. Non

ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

d) Liquidity and size filters are applied to fulfil the Selected Universe.

e) At each rebalancing, securities in the selected universe are weighted in proportion to their float-adjusted market capitalization.

f) An iterative downweighting ensure that the carbon emission intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the Parent Index.

g) Finally, the index constrains the weight of the largest group entity at 35%, and all other group entities at 20%, with a buffer of 10% applied on these limits at each index rebalancing.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum

proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

- *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called “Community Involvement & Human Rights” which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level

of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the MULTI UNITS LUXEMBOURG Amundi MSCI Semiconductors ESG Screened (the "Sub-Fund") is to track both the upward and the downward evolution of the MSCI ACWI Semiconductors & Semiconductor Equipment ESG Filtered Net Total Return Index (the "Index") denominated in US Dollars and representative of a select set of companies from the MSCI ACWI Semiconductors and Semiconductor Equipment Index (the "Parent Index") that excludes companies which are Environmental, Social and Governance (ESG) laggards relative to the Parent Index, while minimizing the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the "Tracking Error").

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

● ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

MSCI ACWI Semiconductors & Semiconductor Equipment ESG Filtered Net Total Return Index (the "Index") features the following characteristics:

a) The Index is constructed by selecting stocks from the Parent Index including large and mid cap stocks across developed and emerging countries.

b) An ESG negative screening is performed on the Parent Index securities as defined in the methodology in order to exclude:

- Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of United Nations Global Compact (UNGC) principles;
- Companies involved in very severe business controversies as defined by the MSCI ESG Controversies;
- Companies with no "ESG Rating" or Controversy Score (as defined by MSCI).

Additionally, an "emerging markets securities filter" is applied to finalize the "Eligible Universe".

c) The selected universe ("Selected Universe") is constructed based on the Eligible Universe by using a "Best-in-class" approach: bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined

by MSCI) are excluded from the Eligible Universe. “Best-in-class” approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company’s resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company’s core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers). Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Principal risks” of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

d) Liquidity and size filters are applied to fulfil the Selected Universe.

e) At each rebalancing, securities in the selected universe are weighted in proportion to their float-adjusted market capitalization.

f) An iterative downweighting ensure that the carbon emission intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the Parent Index.

g) Finally, the index contrains the weight of the largest group entity at 35%, and all other group entities at 20%, with a buffer of 10% applied on these limits at each index rebalancing.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi’s ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer’s ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer’s value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders’ rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

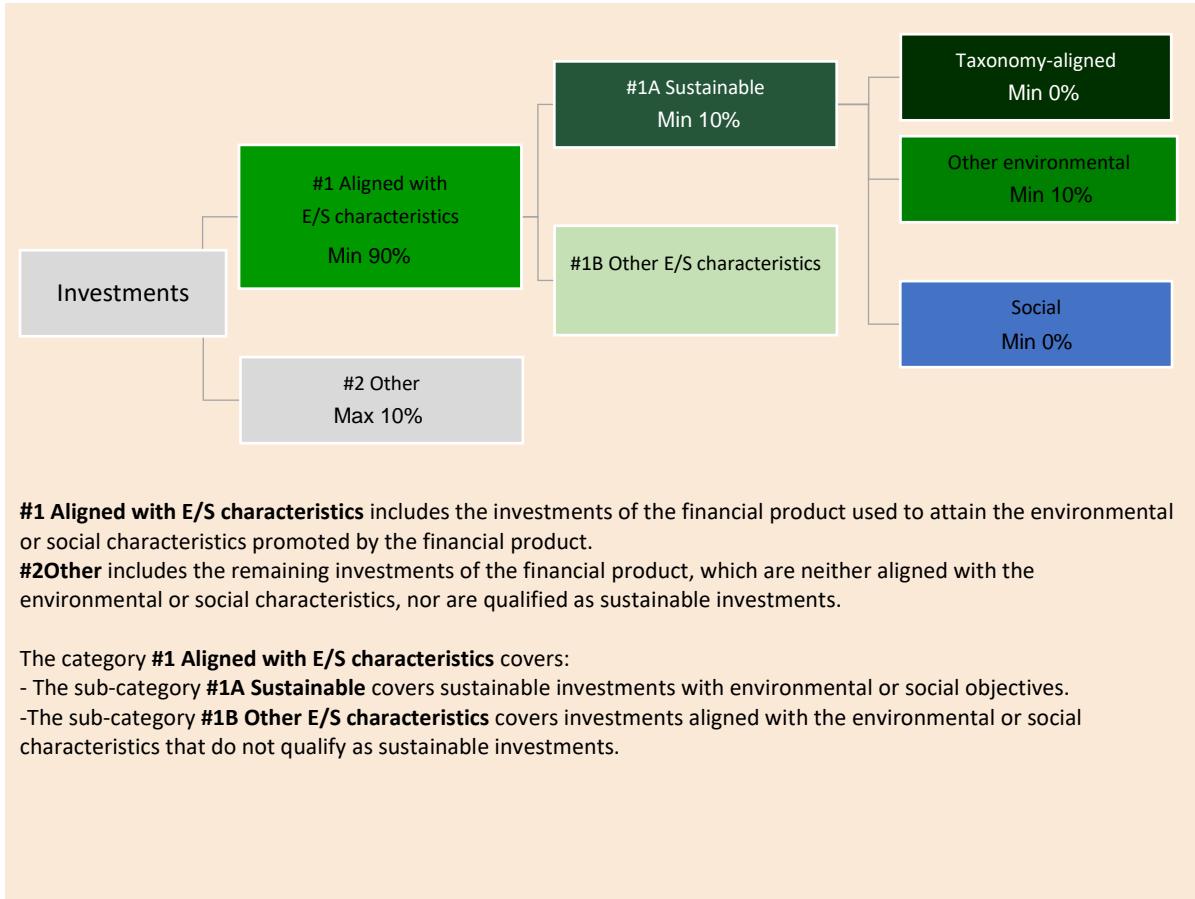
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 10% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 10% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

The environmental or social characteristics promoted by the Sub-Fund are attained through the use of total return swap(s). Indeed the Sub-Fund carries out its investment objective via an Direct Replication as described in the Prospectus. As such the exposure to the performance of the Index will be achieved by way of derivatives i.e. total return swap(s).



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund currently has no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy. The Sub-Fund does not commit to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, it may invest in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

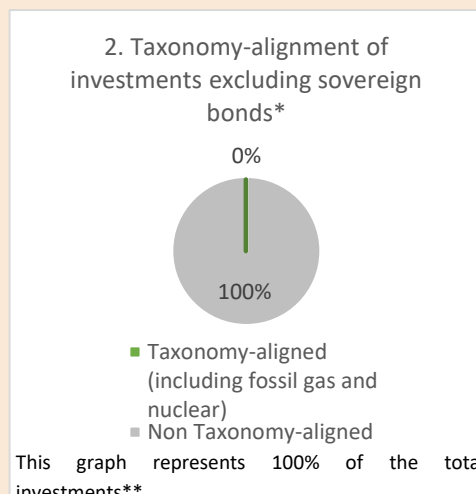
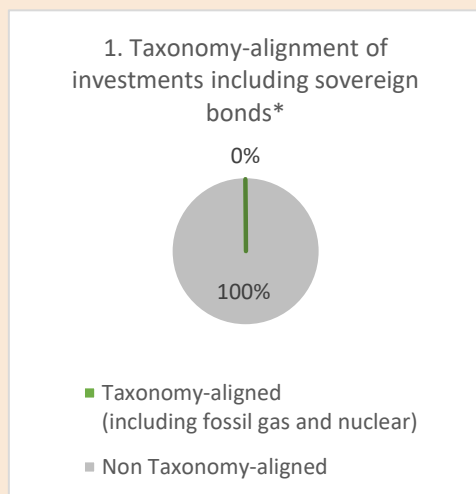
- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.


The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.


 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 10% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.

 **What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?**

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The MSCI ACWI Semiconductors & Semiconductor Equipment ESG Filtered Net Total Return Index (the "Index") is denominated in US Dollars and representative of a select set of companies from the MSCI ACWI Semiconductors and Semiconductor Equipment Index (the "Parent Index") that excludes companies which are Environmental, Social and Governance (ESG) laggards relative to the Parent Index

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.msci.com/index-methodology>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:
Amundi MSCI Europe ESG Leaders

Legal entity identifier:
5493003TSM6WSACG3290

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 30% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index.

“Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The MSCI ESG Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

More detailed on MSCI ESG Rating can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>

More precisely, MSCI Europe ESG Leaders Net Total Return Index (the "Index") features the following characteristics:

- a) Same investment universe of securities as the MSCI Europe Index (the "Parent Index");
- b) Exclusions from the following controversial activities: alcohol, gambling, tobacco, civilian firearms, nuclear power, conventional, nuclear and controversial weapons, fossil fuel extraction and thermal coal power;
- c) Exclusion of companies involved in very severe ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
- d) Exclusion of companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI) or with an ESG Rating lower than 'BB'. MSCI ESG Rating provides an overall company ESG rating – a sevenpoint scale from 'AAA' to 'CCC'. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extrafinancial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics;
- e) The Index is constructed using a "Best-in-class" approach: best ranked companies in each universe, industry, sector or class (in accordance with the Global Industry Classification Standard (GICS)) are selected to construct the Index.

"Best-in-class" is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

The extra financial data coverage is above 90% of the eligible securities of the Index. Filters are less restrictive for stocks already in the Index in order to reduce the turnover on a rebalancing date; and

f) The Index is free float-adjusted market capitalization weighted and the cumulated free-float adjusted market capitalization by GICS sector is overall proportional to the one of the MSCI Europe Index.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm (‘DNSH’), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies)

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and

employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise,

analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund tracks both the upward and the downward evolution of the MSCI Europe ESG Leaders Net Total Return Index (the "Index") denominated in Euros in order to offer an exposure to the performance of large and mid-cap stocks, across developed European countries, issued by companies having a high Environmental, Social and Governance (ESG) ratings – while minimizing the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

MSCI Europe ESG Leaders Net Total Return Index (the "Index") features the following characteristics:

- a) Same investment universe of securities as the MSCI Europe Index (the "Parent Index");
- b) Exclusions from the following controversial activities: alcohol, gambling, tobacco, civilian firearms, nuclear power, conventional, nuclear and controversial weapons, fossil fuel extraction and thermal coal power;
- c) Exclusion of companies involved in very severe ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
- d) Exclusion of companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI) or with an ESG Rating lower than 'BB'. MSCI ESG Rating provides an overall company ESG rating – a sevenpoint scale from 'AAA' to 'CCC'. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extrafinancial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics;
- e) The Index is constructed using a "Best-inclass" approach: best ranked companies in each universe, industry, sector or class (in accordance with the Global Industry Classification Standard (GICS)) are selected to construct the Index.

“Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

The extra financial data coverage is above 90% of the eligible securities of the Index. Filters are less restrictive for stocks already in the Index in order to reduce the turnover on a rebalancing date; and

f) The Index is free float-adjusted market capitalization weighted and the cumulated free-float adjusted market capitalization by GICS sector is overall proportional to the one of the MSCI Europe Index.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi’s ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer’s ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer’s value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders’ rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi’s ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 30% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

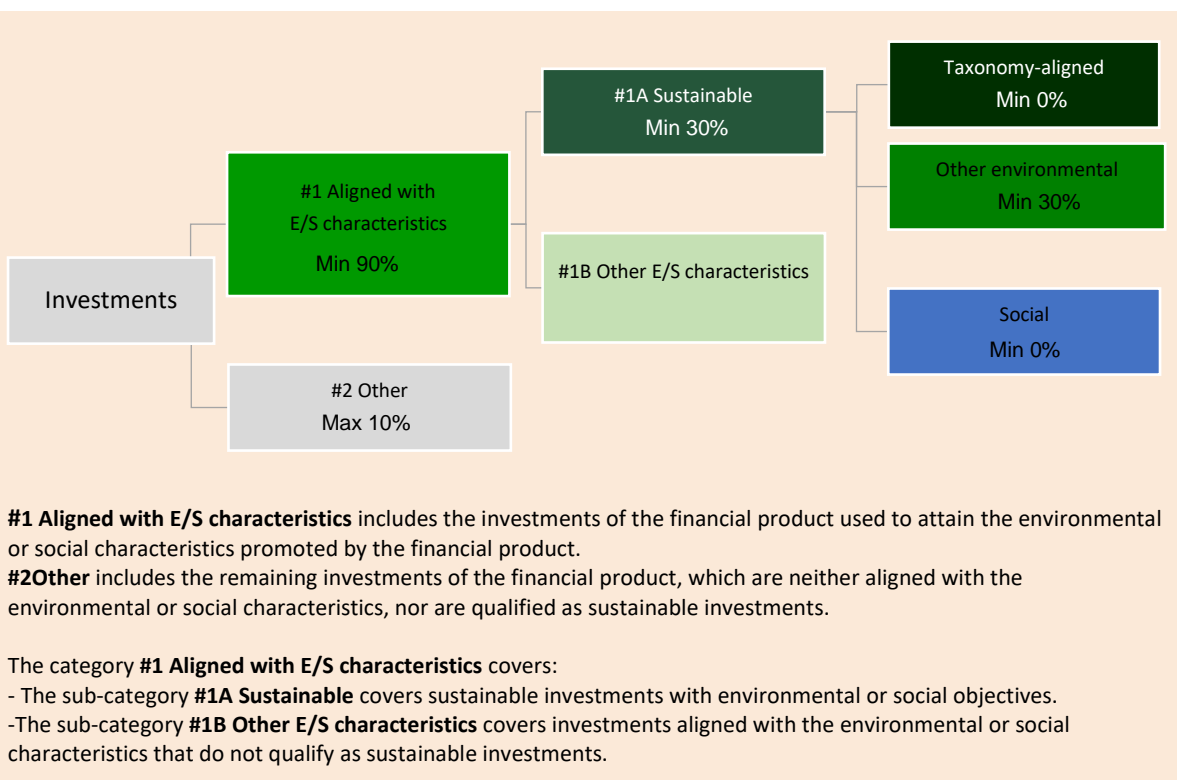
The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 30% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● *How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?*

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

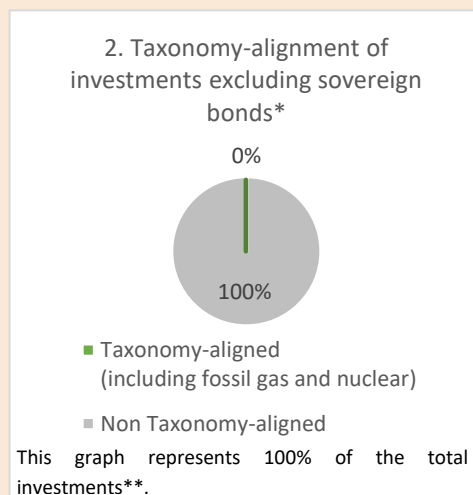
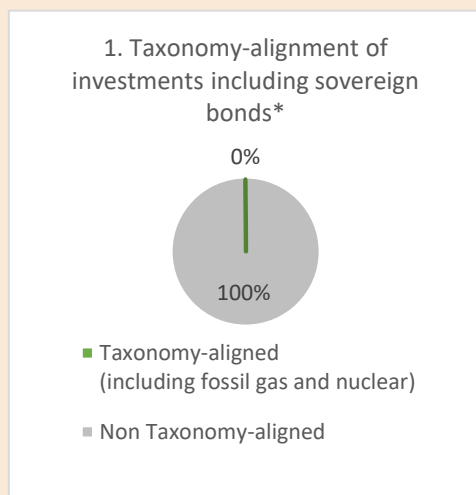
- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 30% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

● **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The MSCI Europe ESG Leaders Net Total Return Index (the "Index") is denominated in Euros in order to offer an exposure to the performance of large and mid cap stocks, across developed European countries, issued by companies having a high Environmental, Social and Governance (ESG) ratings.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.msci.com/index-methodology>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Amundi Global Aggregate Green Bond 1-10Y

Legal entity identifier:
549300AN4QVQ0SPP1Y68

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It promotes **Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 60% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others replicating an Index composed of Green Bonds. To be eligible a bond must be considered as a “Green Bond” by MSCI ESG Research.

Green bonds are fixed income securities in which the proceeds will be exclusively and formally applied to projects or activities that promote climate or other environmental sustainability purposes through their use of proceeds

Sustainability indicators measure how the environmental or social

- **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

characteristics promoted by the financial product are attained.

The use of proceeds of the bonds is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

More precisely, to be eligible for inclusion in the “Bloomberg MSCI Global Green Bond 1-10 Year Index” (the “Index”), a bond must be deemed eligible as a “Green Bond” by MSCI ESG Research (as detailed hereafter). MSCI ESG Research provides in-depth research, ratings and analysis of the environmental, social and governance-related business practices of thousands of companies worldwide. It consists of an integrated suite of tools and products to efficiently manage research, analysis and compliance tasks across the spectrum of ESG factors. An independent research-driven methodology is used to evaluate green bonds to ensure they adhere to established Green Bond principles and are classified by their environmental use of proceeds. MSCI ESG Research has developed and implemented the following set of criteria to defined Green Bonds which are eligible to the index.

Green bonds are fixed income securities in which the proceeds will be exclusively and formally applied to projects or activities that promote climate or other environmental sustainability purposes through their use of proceeds.

Securities (both self-labeled green bonds and unlabeled bonds) are independently evaluated by MSCI ESG Research along four dimensions to determine whether they should be classified as a green bond:

i) Stated use of proceeds: project bonds are considered eligible if the use of proceeds falls within at least one of six eligible environmental categories defined by MSCI ESG Research: Alternative Energy; Energy Efficiency; Pollution Prevention and Control; Sustainable Water; Green Building; and Climate Adaptation.

ii) Process for green project evaluation and selection: Bonds are considered eligible if the issuer clearly delineates the specific criteria and process for determining eligible projects or investments in the bond prospectus or supporting documentation. Project criteria must outline either specific projects or the specific categories of activities to be financed.

iii) Process for management of proceeds: A formal process to ring-fence net proceeds to the eligible use of proceeds must be disclosed in the bond prospectus or supporting documentation. Eligible mechanisms to ring-fence net proceeds include:

- Direct recourse to eligible revenues or assets (e.g., a green securitized bond, green project bond, or green revenue bond);
- Creation of a separate legal entity;
- Creation of a sub-portfolio linked to the issuer’s investment operations for eligible projects;
- Other auditable mechanism whereby the balance of tracked proceeds is reduced periodically by amounts matching investments made in eligible projects during that period.

iv) Commitment to ongoing reporting of the environmental performance of the use of proceeds : At issuance, issuers of index eligible green bonds must either report on projects financed by the bonds’ proceeds, or commit to doing so within one year. This reporting obligation will continue until bond proceeds have been fully dispersed or for the life of the bond, as circumstances necessitate. For reporting to be considered eligible, it must include one or more of the following:

- A list of specific projects/investments, including amount disbursed to each individual project;
- Aggregate project/investment categories, including amount disbursed to each project type;
- Quantitative or qualitative reporting on the environmental impact of the project pool (e.g., greenhouse gas emissions savings, reduction in water consumption, increased energy efficiency per unit of output, etc.).

More information can be found on the website: <https://www.msci.com/>.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that contributes to and has

positive impacts on the energy and ecological transition by investing permanently at least 90% of the net asset value of the Sub-Fund in Green Bonds comprising the Index. To be eligible in the Index, Green Bonds shall meet the criteria defined by MSCI ESG Research (as mentioned above).

Through its methodology and the manner it is constructed (as described above), the Index is aligned with the sustainable investment objective of the Sub-Fund and differs from a broad market index. Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Limits of the extra-financial approach” of the prospectus.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Principal adverse impacts are the most significant

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called “Community Involvement & Human Rights” which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and the downward evolution of the “Bloomberg MSCI Global Green Bond 1-10 Year Index” (the “Index”) denominated in Euros, in order to offer an exposure to the Green Bonds market issued by investment grade entities and denominated in multiple currencies – while minimising the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the “Tracking Error”).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

To be eligible for inclusion in the “Bloomberg MSCI Global Green Bond 1-10 Year Index” (the “Index”), a bond must be deemed eligible as a “Green Bond” by MSCI ESG Research (as detailed hereafter). MSCI ESG Research provides in-depth research, ratings and analysis of the environmental, social and governance-related business practices of thousands of companies worldwide. It consists of an integrated suite of tools and products to efficiently manage research, analysis and compliance tasks across the spectrum of ESG factors. An independent research-driven methodology is used to evaluate green bonds to ensure they adhere to established Green Bond principles and are classified by their environmental use of proceeds. MSCI ESG Research has developed and implemented the following set of criteria to defined Green Bonds which are eligible to the index.

Green bonds are fixed income securities in which the proceeds will be exclusively and formally applied to projects or activities that promote climate or other environmental sustainability purposes through their use of proceeds.

Securities (both self-labeled green bonds and unlabeled bonds) are independently evaluated by MSCI ESG Research along four dimensions to determine whether they should be classified as a green bond:

i) Stated use of proceeds: project bonds are considered eligible if the use of proceeds falls within at least one of six eligible environmental categories defined by MSCI ESG Research: Alternative Energy; Energy Efficiency; Pollution Prevention and Control; Sustainable Water; Green Building; and Climate Adaptation.

ii) Process for green project evaluation and selection: Bonds are considered eligible if the issuer clearly delineates the specific criteria and process for determining eligible projects or investments in the bond prospectus or supporting documentation. Project criteria must outline either specific projects or the specific categories of activities to be financed.

iii) Process for management of proceeds: A formal process to ring-fence net proceeds to the eligible use of proceeds must be disclosed in the bond prospectus or supporting documentation. Eligible mechanisms to ring-fence net proceeds include:

- Direct recourse to eligible revenues or assets (e.g., a green securitized bond, green project bond, or green revenue bond);
- Creation of a separate legal entity;
- Creation of a sub-portfolio linked to the issuer's investment operations for eligible projects;
- Other auditable mechanism whereby the balance of tracked proceeds is reduced periodically by amounts matching investments made in eligible projects during that period.

iv) Commitment to ongoing reporting of the environmental performance of the use of proceeds : At issuance, issuers of index eligible green bonds must either report on projects financed by the bonds' proceeds, or commit to doing so within one year. This reporting obligation will continue until bond proceeds have been fully dispersed or for the life of the bond, as circumstances necessitate. For reporting to be considered eligible, it must include one or more of the following:

- A list of specific projects/investments, including amount disbursed to each individual project;
- Aggregate project/investment categories, including amount disbursed to each project type;
- Quantitative or qualitative reporting on the environmental impact of the project pool (e.g., greenhouse gas emissions savings, reduction in water consumption, increased energy efficiency per unit of output, etc.).

More information can be found on the website: <https://www.msci.com/>.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that contributes to and has positive impacts on the energy and ecological transition by investing permanently at least 90% of the net asset value of the Sub-Fund in Green Bonds comprising the Index. To be eligible in the Index, Green Bonds shall meet the criteria defined by MSCI ESG Research (as mentioned above).

Through its methodology and the manner it is constructed (as described above), the Index is aligned with the sustainable investment objective of the Sub-Fund and differs from a broad market index. Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section "Limits of the extra-financial approach" of the prospectus.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

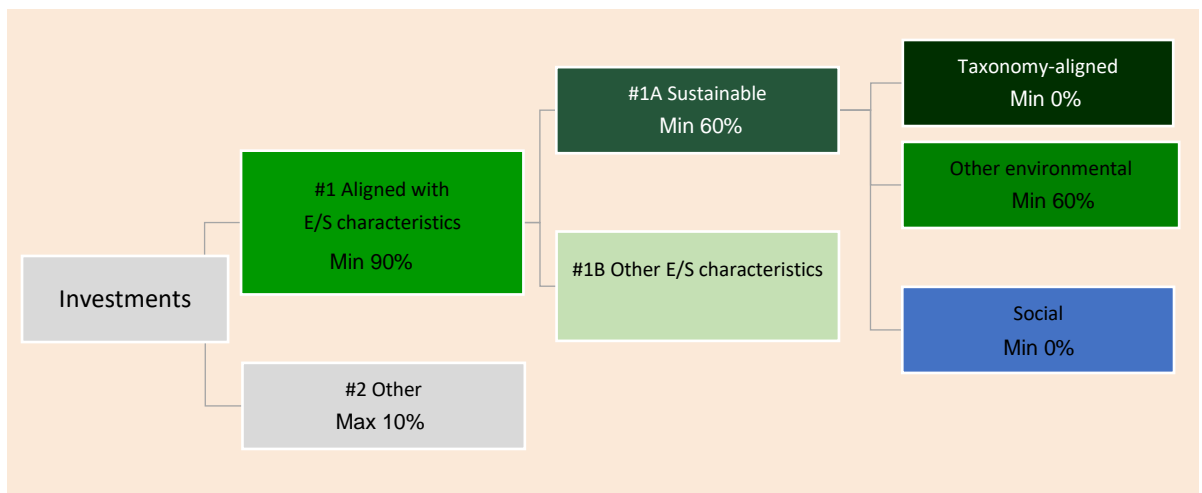
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 60% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 60% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure (CapEx) showing



the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.

#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2Other includes the remaining investments of the financial product, which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

The category **#1 Aligned with E/S characteristics** covers:

- The sub-category **#1A Sustainable** covers sustainable investments with environmental or social objectives.

-The sub-category **#1B Other E/S characteristics** covers investments aligned with the environmental or social characteristics that do not qualify as sustainable investments.

- ***How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

- ***Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?***

Yes:

In fossil gas

In nuclear energy

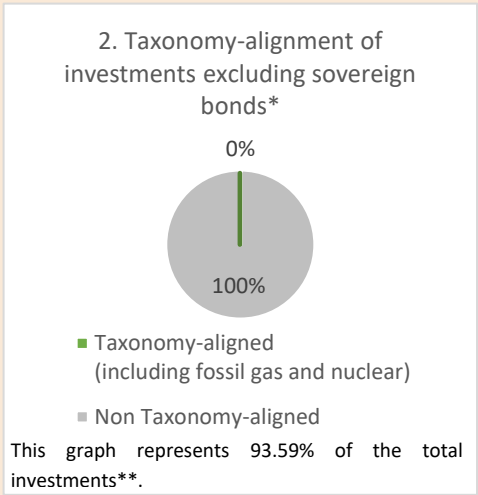
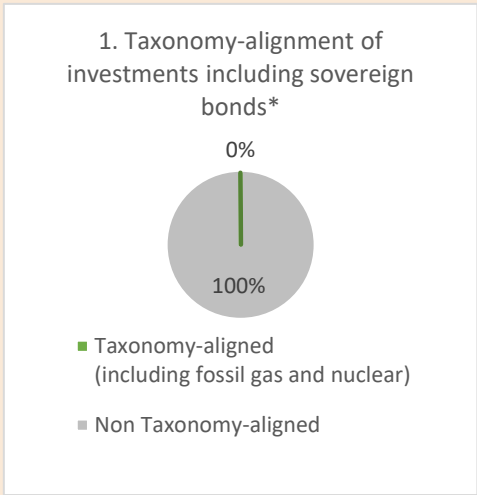
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

- **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 60% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The “Bloomberg MSCI Global Green Bond 1-10 Year Index” (the “Index”) offers an exposure to the Green Bonds market issued by investment grade entities and denominated in multiple currencies

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:

Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR)
UCITS ETF

Legal entity identifier:

5493005U8VB8WI2D3X04

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 35% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index that is meeting the minimum standards for EU Climate Transition Benchmarks (EU CTBs) under Regulation (EU) 2019/2089 amending Regulation (EU) 2016/1011. The law proposes the definitions of minimum standards for the methodology of any 'EU Climate Transition' benchmark indices that would be aligned with the objectives of the Paris Agreement. The Index methodology align with certain criteria such as:

- A minimum reduction in Greenhouse Gas (GHG) intensity relative to Parent Index of 30%.
- A minimum self-decarbonization rate of GHG emissions intensity in accordance with the trajectory implied by Intergovernmental Panel on Climate Change's (IPCC) most ambitious 1.5°C scenario, equating to at least 7% GHG intensity reduction on average per annum.

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The weighted average greenhouse gas (GHG) intensity (the “WACI”) is used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product.

The WACI is the weighted average of the Index components’ greenhouse gas (GHG) emissions (expressed in tCO₂) divided by the enterprise value including cash.

The GHG emissions are divided into Scope 1, Scope 2, and Scope 3 emissions.

-Scope 1 emissions: those from sources owned or controlled by the company.

-Scope 2 emissions: those caused by the generation of electricity purchased by the company.

-Scope 3 emissions: include all other indirect emissions that occur in a company’s value chain.

More precisely, MSCI Europe ESG Climate Transition (EU CTB) Select Net Total Return Index (the “Index”) is based on the Parent Index and includes large and mid-cap securities of the European developed equity market. It aims to represent the performance of an investment strategy designed to exceed the minimum standards of the EU CTB under the Benchmark Regulation. It incorporates ESG criteria and a broad range of climate-related objectives covering transition risk, climate change opportunities and physical risk while minimizing the volatility of the difference between the return of the Index and the return of the Parent Index.

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI which features the following characteristics:

1) Eligible Universe:

a) Same investment universe as the Parent Index;

b) ESG value-based exclusions from the following activities: controversial, conventional, civilian and nuclear weapons, tobacco, thermal coal and soil sands extraction;

c) Exclusion of companies not in compliance with the United Nations Global Compact (UNGC) principles;

d) Exclusion of companies involved in a major ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);

e) ESG Score Based Exclusions: All companies in the bottom 25% of the cumulative security free float market capitalization of the Parent Index in descending order of their ESG Score.

2) Optimization constraints: at each SemiAnnual Index Review of the MSCI Global Investable Market Indexes, the Index is constructed using an optimization process that aims to achieve replicability and investability as well as minimize ex-ante tracking error relative to the Parent Index subject to the following constraints:

a) Minimum reduction in Greenhouse Gas (GHG) intensity (Scope 1+2+3, based on Annex III of the Benchmark Regulation) relative to Parent Index of 30%;

b) Minimum average reduction (per annum) in GHG intensity relative to GHG intensity at the Base Date (defined as June 1st, 2020) of 7.35%;

- c) Minimum active weight in High Climate Impact Sector (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index of 0%;
- d) Minimum increase in aggregate weight in companies setting targets relative to the aggregate weight of such companies in the Parent Index of 20%;
- e) Minimum reduction in Weighted Average Potential Emissions Intensity (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index of 30%;
- f) Improving the Aggregate Climate Value-At-Risk (as defined in the methodology of the Index) under 1.5 degree scenario relative to the Parent Index;
- g) Minimum reduction in Weighted Average Extreme Weather Climate Value-At-Risk (Aggressive Scenario) (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index of 50%;
- h) Minimum ratio of Weighted Average Green Revenue/ Weighted Average Brown Revenue (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index of 4;
- i) Minimum increase in Weighted Average Green Revenue (as defined in the methodology of the Index) relative to the Parent Index of 100%.
- j) Minimum increase in weighted average board independence percent (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide

manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi's above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a "do not significant harm" principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The "do no significant harm" principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund's strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi's voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi's Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor MSCI Europe ESG Climate Transition CTB (DR) UCITS ETF (the “Sub-Fund”) is to track both the upward and the downward evolution of the MSCI Europe ESG Climate Transition (EU CTB) Select Net Total Return Index (the “Index”) denominated in Euros and representative of the performance of an investment strategy constructed from the MSCI Europe Index (the "Parent Index") and designed to exceed the minimum standards of the EU Climate Transition Benchmarks (the “EU CTB”) required under delegated acts supplementing Regulation (EU) 2019/2089 amending Regulation (EU) 2016/1011 (the “Benchmark Regulation”), while minimizing the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the “Tracking Error”).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- **What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

MSCI Europe ESG Climate Transition (EU CTB) Select Net Total Return Index (the “Index”) is based on the Parent Index and includes large and mid-cap securities of the European developed equity market. It aims to represent the performance of an investment strategy designed to exceed the minimum standards of the EU CTB under the Benchmark Regulation. It incorporates ESG criteria and a broad range of climate-related objectives covering transition risk, climate change opportunities and physical risk while minimizing the volatility of the difference between the return of the Index and the return of the Parent Index.

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI which features the following characteristics:

1) Eligible Universe:

- a) Same investment universe as the Parent Index;
- b) ESG value-based exclusions from the following activities: controversial, conventional, civilian and nuclear weapons, tobacco, thermal coal and soil sands extraction;
- c) Exclusion of companies not in compliance with the United Nations Global Compact (UNGC) principles;
- d) Exclusion of companies involved in a major ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
- e) ESG Score Based Exclusions: All companies in the bottom 25% of the cumulative security free float market capitalization of the Parent Index in descending order of their ESG Score.

2) Optimization constraints: at each SemiAnnual Index Review of the MSCI Global Investable Market Indexes, the Index is constructed using an optimization process that aims to achieve replicability and investability as well as minimize ex-ante tracking error relative to the Parent Index subject to the following constraints:

- a) Minimum reduction in Greenhouse Gas (GHG) intensity (Scope 1+2+3, based on Annex III of the Benchmark Regulation) relative to Parent Index of 30%;
- b) Minimum average reduction (per annum) in GHG intensity relative to GHG intensity at the Base Date (defined as June 1st, 2020) of 7.35%;
- c) Minimum active weight in High Climate Impact Sector (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index of 0%;
- d) Minimum increase in aggregate weight in companies setting targets relative to the aggregate weight of such companies in the Parent Index of 20%;
- e) Minimum reduction in Weighted Average Potential Emissions Intensity (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index of 30%;
- f) Improving the Aggregate Climate Value-At-Risk (as defined in the methodology of the Index) under 1.5 degree scenario relative to the Parent Index;
- g) Minimum reduction in Weighted Average Extreme Weather Climate Value-At-Risk (Aggressive Scenario) (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index of 50%;
- h) Minimum ratio of Weighted Average Green Revenue/ Weighted Average Brown Revenue (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index of 4;
- i) Minimum increase in Weighted Average Green Revenue (as defined in the methodology of the Index) relative to the Parent Index of 100%.
- j) Minimum increase in weighted average board independence percent (as defined in the methodology of the Index) relative to Parent Index.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 35% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

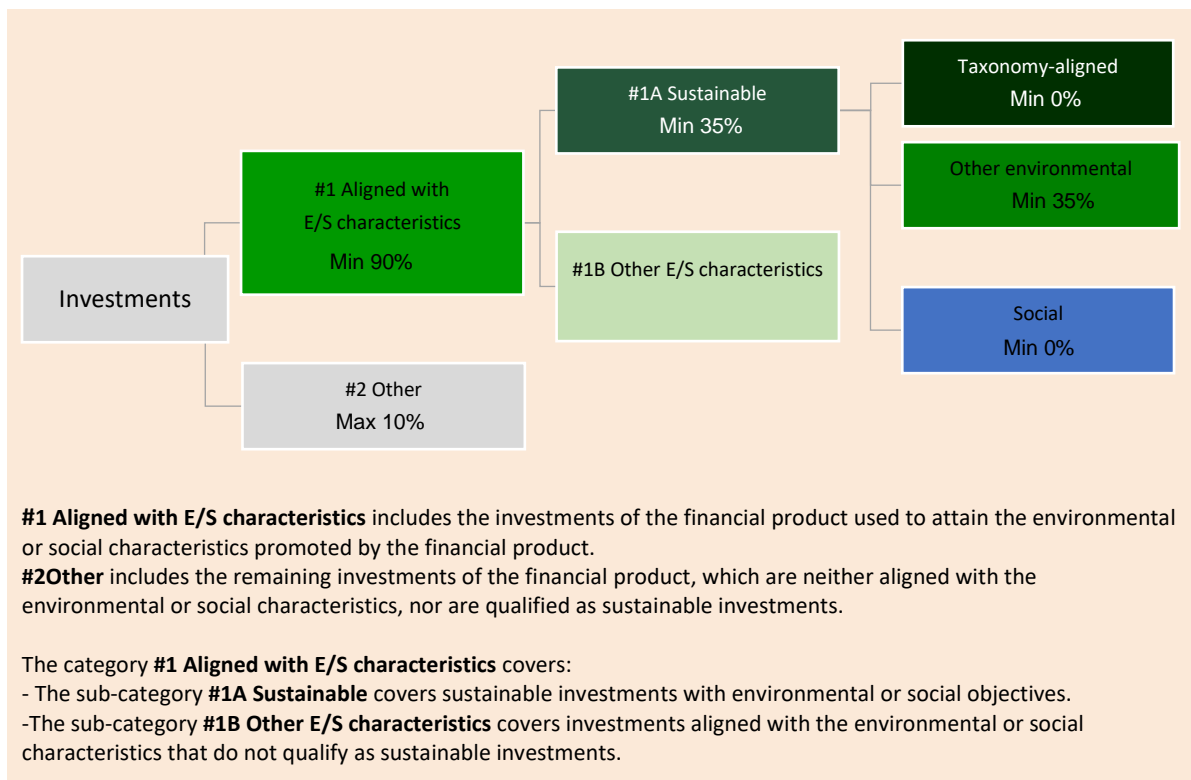
The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 35% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund currently has no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy. The Sub-Fund does not commit to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, it may invest in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

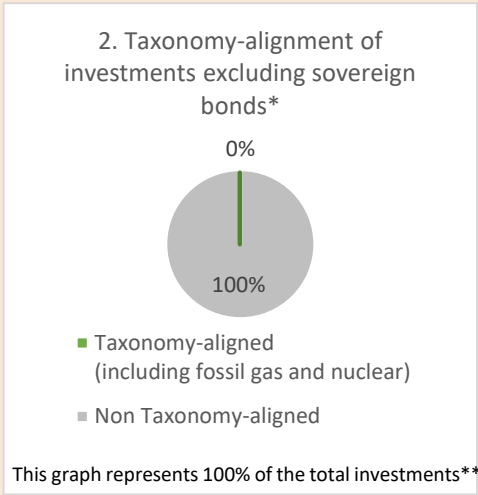
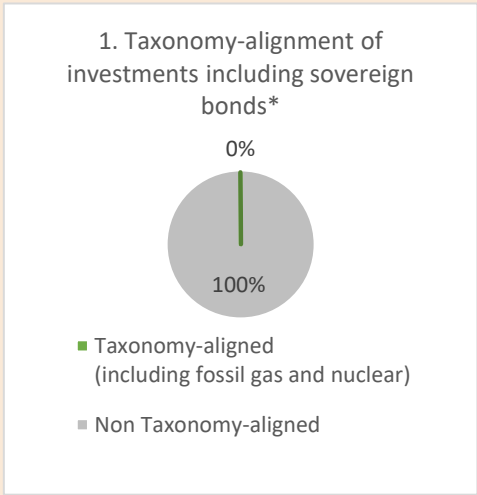
- Yes:
 - In fossil gas
 - In nuclear energy
- No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.


The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.


● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.


 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 35% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.

 **What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?**

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The MSCI Europe ESG Climate Transition (EU CTB) Select Net Total Return Index (the "Index") is denominated in Euros and representative of the performance of an investment strategy constructed from the MSCI Europe Index (the "Parent Index") and designed to exceed the minimum standards of the EU Climate Transition Benchmarks (the "EU CTB") required under delegated acts supplementing Regulation (EU) 2019/2089 amending Regulation (EU) 2016/1011 (the "Benchmark Regulation")

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.msci.com/index-methodology>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Amundi S&P Eurozone PAB Net Zero Ambition

Legal entity identifier:
549300S2QFMA0J61VE20

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 40% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index that is meeting the minimum standards for EU Paris Aligned Benchmarks (EU PABs) under Regulation (EU) 2019/2089 amending Regulation (EU) 2016/1011. The law proposes the definitions of minimum standards for the methodology of any 'EU Paris Aligned' benchmark indices that would be aligned with the objectives of the Paris Agreement. The Index methodology align with certain criteria such as:

- A minimum reduction in Greenhouse Gas (GHG) intensity relative to Parent Index of 50%.
- A minimum self-decarbonization rate of GHG emissions intensity in accordance with the trajectory implied by Intergovernmental Panel on Climate Change's (IPCC) most ambitious 1.5°C scenario, equating to at least 7% GHG intensity reduction on average per annum

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The weighted average greenhouse gas (GHG) intensity (the “WACI”) is used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product.

The WACI is the weighted average of the Index components’ greenhouse gas (GHG) emissions (expressed in tCO₂) divided by the enterprise value including cash.

The GHG emissions are divided into Scope 1, Scope 2, and Scope 3 emissions.

- Scope 1 emissions: those from sources owned or controlled by the company.
- Scope 2 emissions: those caused by the generation of electricity purchased by the company.
- Scope 3 emissions: include all other indirect emissions that occur in a company’s value chain.

More precisely, S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index (the “Index”) is based on the Parent Index which is representative of large and mid-cap securities of the Eurozone equity markets. The Index measures the performance of eligible equity securities from the Parent Index, selected and weighted to be collectively compatible with a 1.5°C global warming climate scenario. It incorporates a broad range of climate-related objectives covering transition risk, climate change opportunities and physical risk.

The Index has been designed to align with the minimum standards as proposed in the Final Report of the European Union’s Technical Expert Group on Climate Benchmarks and ESG Disclosures (the “TEG”) and qualify for the label ‘EU Paris-aligned benchmarks’ (“EU PAB”). The proposals contained in the Final Report are not legally binding. The Final Report will serve as the basis for the European Commission to draft delegated acts to implement the requirements of Regulation (EU) 2019/2089. Following publication of the final delegated acts, the methodology will be reviewed and updated if required to align with any relevant changes to the minimum standards for EU Paris-aligned benchmarks. Should a change to the methodology be required, S&P Dow Jones Indices will issue an announcement before the change is implemented (and in these circumstances, S&P Dow Jones Indices would not conduct a formal consultation).

The weighting strategy of the Index aims to minimize the difference in constituent weights to the Parent Index while simultaneously delivering objectives through optimization constraints, including:

- a) alignment to 1.5°C climate scenario using Trucost’s Transition Pathway Model as defined in the methodology of the Index;
- b) reduced overall greenhouse gas (GHG expressed in CO₂ equivalents) emissions intensity compared to the Parent Index by at least 50%;
- c) minimum self-decarbonization rate of greenhouse gas emissions intensity in accordance with the trajectory implied by IPCC’s most ambitious 1.5°C scenario, equating to at least 7% GHG intensity reduction on average per annum;
- d) increased exposure to companies with Science Based Targets from the Science Based Target Initiative (SBTI) that are credible and consistent with the above decarbonization trajectory;
- e) improved S&P DJI ESG Score (as defined in the methodology of the Index) with regard to the S&P DJI

ESG Score of the Parent Index after 20% of the worst ESG score performing companies by count are removed and weight redistributed;

f) exposure to sectors with high impact to climate change at least equivalent to the Parent Index;

g) capped exposure to non-disclosing carbon companies;

h) constituent-level weight capping to address liquidity and diversification as defined in the methodology of the Index;

i) reduced exposure to physical risks from climate change using Trucost's Physical Risk dataset as defined in the methodology of the Index;

j) improved exposure to potential climate change opportunities through substantially higher green-to-brown revenue share; and

k) reduced exposure to fossil fuel reserves.

The Index features exclusions for companies from the Parent Index with:

i) controversial weapons, tobacco, small arms, military contracting, thermal coal, oil sands, shale energy, gambling and alcohol business activities based on revenue thresholds as defined in the methodology of the Index;

ii) an impact on stakeholders deemed by Sustainalytics to be non-compliant with international norms; and

iii) public, ESG-related, controversial news (Media & Stakeholder Analysis or MSA) as defined in the methodology of the Index.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction of overall greenhouse gas emissions intensity compared to the Parent Index by at least 50%.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundi-etf.com/>.

The extra financial data coverage is at least 90% of the eligible equity securities of the Index.

The Index features additional exclusions for companies that exceed derived revenue thresholds in coal/oil/natural gas exploration or processing activities and electricity generation subject to certain GHG intensities.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

1) follow best environmental and social practices; and

2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm (‘DNSH’), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company’s carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi’s Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi’s ESG rating.

- *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

- *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a "do not significant harm" principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The "do no significant harm" principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial

product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund's strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi's voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi's Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and the downward evolution of the S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index (the "Index"), denominated in Euros, and representative of the performance of eligible equity securities from the S&P Eurozone LargeMidCap Index (the "Parent Index") selected and weighted to be collectively compatible with a 1.5°C global warming climate

scenario, while minimizing the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the “Tracking Error”).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index (the “Index”) is based on the Parent Index which is representative of large and mid-cap securities of the Eurozone equity markets. The Index measures the performance of eligible equity securities from the Parent Index, selected and weighted to be collectively compatible with a 1.5°C global warming climate scenario. It incorporates a broad range of climate-related objectives covering transition risk, climate change opportunities and physical risk.

The Index has been designed to align with the minimum standards as proposed in the Final Report of the European Union’s Technical Expert Group on Climate Benchmarks and ESG Disclosures (the “TEG”) and qualify for the label ‘EU Paris-aligned benchmarks’ (“EU PAB”). The proposals contained in the Final Report are not legally binding. The Final Report will serve as the basis for the European Commission to draft delegated acts to implement the requirements of Regulation (EU) 2019/2089. Following publication of the final delegated acts, the methodology will be reviewed and updated if required to align with any relevant changes to the minimum standards for EU Paris-aligned benchmarks. Should a change to the methodology be required, S&P Dow Jones Indices will issue an announcement before the change is implemented (and in these circumstances, S&P Dow Jones Indices would not conduct a formal consultation).

The weighting strategy of the Index aims to minimize the difference in constituent weights to the Parent Index while simultaneously delivering objectives through optimization constraints, including:

- a) alignment to 1.5°C climate scenario using Trucost’s Transition Pathway Model as defined in the methodology of the Index;
- b) reduced overall greenhouse gas (GHG expressed in CO₂ equivalents) emissions intensity compared to the Parent Index by at least 50%;
- c) minimum self-decarbonization rate of greenhouse gas emissions intensity in accordance with the trajectory implied by IPCC’s most ambitious 1.5°C scenario, equating to at least 7% GHG intensity reduction on average per annum;
- d) increased exposure to companies with Science Based Targets from the Science Based Target Initiative (SBTI) that are credible and consistent with the above decarbonization trajectory;
- e) improved S&P DJI ESG Score (as defined in the methodology of the Index) with regard to the S&P DJI ESG Score of the Parent Index after 20% of the worst ESG score performing companies by count are

removed and weight redistributed;

f) exposure to sectors with high impact to climate change at least equivalent to the Parent Index;

g) capped exposure to non-disclosing carbon companies;

h) constituent-level weight capping to address liquidity and diversification as defined in the methodology of the Index;

i) reduced exposure to physical risks from climate change using Trucost's Physical Risk dataset as defined in the methodology of the Index;

j) improved exposure to potential climate change opportunities through substantially higher green-to-brown revenue share; and

k) reduced exposure to fossil fuel reserves.

The Index features exclusions for companies from the Parent Index with:

i) controversial weapons, tobacco, small arms, military contracting, thermal coal, oil sands, shale energy, gambling and alcohol business activities based on revenue thresholds as defined in the methodology of the Index;

ii) an impact on stakeholders deemed by Sustainalytics to be non-compliant with international norms; and

iii) public, ESG-related, controversial news (Media & Stakeholder Analysis or MSA) as defined in the methodology of the Index.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction of overall greenhouse gas emissions intensity compared to the Parent Index by at least 50%.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

The extra financial data coverage is at least 90% of the eligible equity securities of the Index.

The Index features additional exclusions for companies that exceed derived revenue thresholds in coal/oil/natural gas exploration or processing activities and electricity generation subject to certain GHG intensities.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance
practices include
sound management
structures,

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

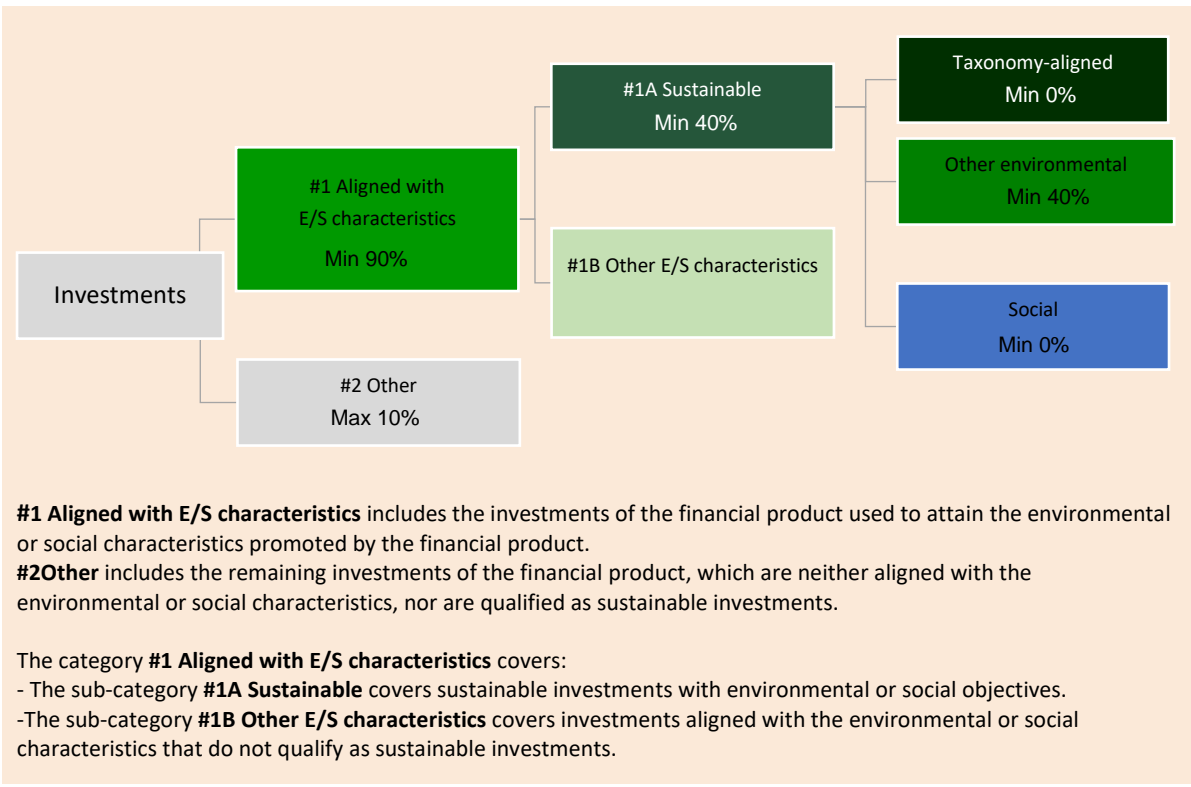
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 40% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 40% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.

 **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

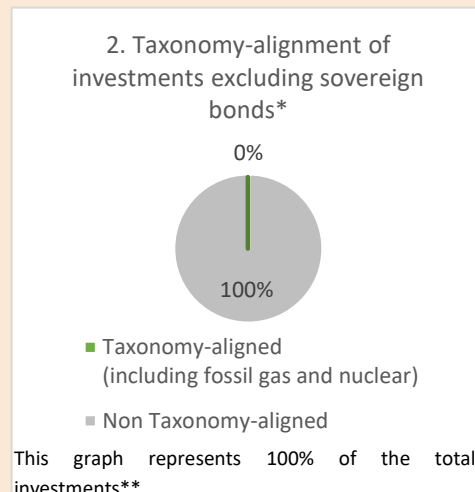
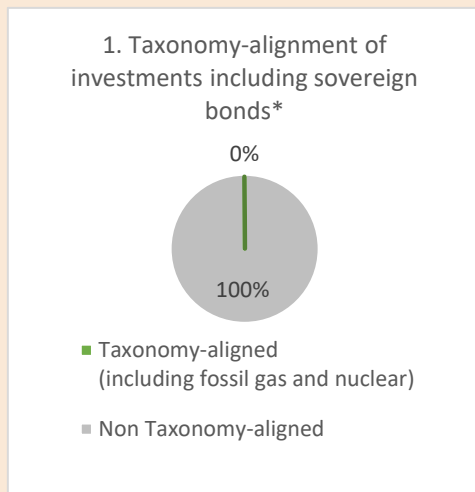
No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 40% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

● **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The S&P Eurozone LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index (the “Index”), denominated in Euros, and representative of the performance of eligible equity securities from the S&P Eurozone LargeMidCap Index (the “Parent Index”) selected and weighted to be collectively compatible with a 1.5°C global warming climate scenario.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.spglobal.com/spdji/en/index-family/esg/esg-climate/paris-aligned-climate-transition-pact/#overview>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name: Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF
Legal entity identifier: 549300ZEQXL0Z5VWDJ60

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%



It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 35% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index that is meeting the minimum standards for EU Paris Aligned Benchmarks (EU PABs) under Regulation (EU) 2019/2089 amending Regulation (EU) 2016/1011. The law proposes the definitions of minimum standards for the methodology of any 'EU Paris Aligned' benchmark indices that would be aligned with the objectives of the Paris Agreement. The Index methodology align with certain criteria such as:

- A minimum reduction in Greenhouse Gas (GHG) intensity relative to Parent Index of 50%.
- A minimum self-decarbonization rate of GHG emissions intensity in accordance with the trajectory implied by Intergovernmental Panel on Climate Change's (IPCC) most ambitious 1.5°C scenario, equating to at least 7% GHG intensity reduction on average per annum

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The weighted average greenhouse gas (GHG) intensity (the “WACI”) is used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product.

The WACI is the weighted average of the Index components’ greenhouse gas (GHG) emissions (expressed in tCO₂) divided by the enterprise value including cash.

The GHG emissions are divided into Scope 1, Scope 2, and Scope 3 emissions.

- Scope 1 emissions: those from sources owned or controlled by the company.
- Scope 2 emissions: those caused by the generation of electricity purchased by the company.
- Scope 3 emissions: include all other indirect emissions that occur in a company’s value chain.

More precisely, S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index (the “Index”) is based on the Parent Index which is representative of large and mid-cap securities of the European equity markets. The Index measures the performance of eligible equity securities from the Parent Index, selected and weighted to be collectively compatible with a 1.5°C global warming climate scenario. It incorporates a broad range of climate-related objectives covering transition risk, climate change opportunities and physical risk.

The Index has been designed to align with the minimum standards as proposed in the Final Report of the European Union’s Technical Expert Group on Climate Benchmarks and ESG Disclosures (the “TEG”) and qualify for the label ‘EU Paris-aligned benchmarks (“EU PAB”). The proposals contained in the Final Report are not legally binding. The Final Report will serve as the basis for the European Commission to draft delegated acts to implement the requirements of Regulation (EU) 2019/2089. Following publication of the final delegated acts, the methodology will be reviewed and updated if required to align with any relevant changes to the minimum standards for EU Paris-aligned benchmarks. Should a change to the methodology be required, S&P Dow Jones Indices will issue an announcement before the change is implemented (and in these circumstances, S&P Dow Jones Indices would not conduct a formal consultation).

The weighting strategy of the Index aims to minimize the difference in constituent weights to the Parent Index while simultaneously delivering objectives through optimization constraints, including:

- a) alignment to 1.5°C climate scenario using Trucost’s Transition Pathway Model as defined in the methodology of the Index;
- b) reduced overall greenhouse gas (GHG expressed in CO₂ equivalents) emissions intensity compared to the Parent Index by at least 50%;
- c) minimum self-decarbonization rate of greenhouse gas emissions intensity in accordance with the trajectory implied by IPCC’s most ambitious 1.5°C scenario, equating to at least 7% GHG intensity reduction on average per annum;
- d) increased exposure to companies with Science Based Targets from the Science Based Target Initiative (SBTI) that are credible and consistent with the above decarbonization trajectory;
- e) improved S&P DJI ESG Score (as defined in the methodology of the Index) with regard to the S&P DJI ESG Score of the Parent Index after 20% of the worst ESG score performing companies by count are

removed and weight redistributed;

f) exposure to sectors with high impact to climate change at least equivalent to the Parent Index;

g) capped exposure to non-disclosing carbon companies;

h) constituent-level weigh capping to address liquidity and diversification as defined in the methodology of the Index;

i) reduced exposure to physical risks from climate change using Trucost's Physical Risk dataset as defined in the methodology of the Index;

j) improved exposure to potential climate change opportunities through substantially higher green-to-brown revenue share; and

k) reduced exposure to fossil fuel reserves.

The Index features exclusions for companies from the Parent Index with:

i) controversial weapons, tobacco, small arms, military contracting, thermal coal, oil sands, shale energy, gambling and alcohol business activities based on revenue thresholds as defined in the methodology of the Index;

ii) an impact on stakeholders deemed by Sustainalytics to be non-compliant with international norms ; and

iii) public, ESG-related, controversial news (Media & Stakeholder Analysis or MSA) as defined in the methodology of the Index.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction of overall greenhouse gas emissions intensity compared to the Parent Index by at least 50%.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

The extra financial data coverage is at least 90% of the eligible equity securities of the Index.

The Index features additional exclusions for companies that exceed derived revenue thresholds in coal/oil/natural gas exploration or processing activities and electricity generation subject to certain GHG intensities.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

1) follow best environmental and social practices; and

2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm (‘DNSH’), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company’s carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi’s Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi’s ESG rating.

- *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

- *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the MULTI UNITS LUXEMBOURG – Lyxor Net Zero 2050 S&P Europe Climate PAB (DR) UCITS ETF (the “Sub-Fund”) is to track both the upward and the downward evolution of the S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index (the “Index”), denominated in Euros, and representative of the performance of eligible equity securities from the S&P Europe LargeMidCap Index (the “Parent Index”) selected and weighted to be collectively compatible with a 1.5°C global warming climate scenario, while minimizing the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the “Tracking Error”).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index (the “Index”) is based on the Parent Index which is representative of large and mid-cap securities of the European equity markets. The Index measures the performance of eligible equity securities from the Parent Index, selected and weighted to be collectively compatible with a 1.5°C global warming climate scenario. It incorporates a broad range of climate-related objectives covering transition risk, climate change opportunities and physical risk.

The Index has been designed to align with the minimum standards as proposed in the Final Report of the European Union’s Technical Expert Group on Climate Benchmarks and ESG Disclosures (the “TEG”) and qualify for the label ‘EU Paris-aligned benchmarks (“EU PAB”). The proposals contained in the Final Report are not legally binding. The Final Report will serve as the basis for the European Commission to draft delegated acts to implement the requirements of Regulation (EU) 2019/2089. Following publication of the final delegated acts, the methodology will be reviewed and updated if required to align with any relevant changes to the minimum standards for EU Paris-aligned benchmarks. Should a change to the methodology be required, S&P Dow Jones Indices will issue an announcement before the change is implemented (and in these circumstances, S&P Dow Jones Indices would not conduct a formal consultation).

The weighting strategy of the Index aims to minimize the difference in constituent weights to the Parent Index while simultaneously delivering objectives through optimization constraints, including:

- a) alignment to 1.5°C climate scenario using Trucost’s Transition Pathway Model as defined in the methodology of the Index;
- b) reduced overall greenhouse gas (GHG expressed in CO₂ equivalents) emissions intensity compared to the Parent Index by at least 50%;
- c) minimum self-decarbonization rate of greenhouse gas emissions intensity in accordance with the trajectory implied by IPCC’s most ambitious 1.5°C scenario, equating to at least 7% GHG intensity reduction on average per annum;

- d) increased exposure to companies with Science Based Targets from the Science Based Target Initiative (SBTI) that are credible and consistent with the above decarbonization trajectory;
- e) improved S&P DJI ESG Score (as defined in the methodology of the Index) with regard to the S&P DJI ESG Score of the Parent Index after 20% of the worst ESG score performing companies by count are removed and weight redistributed;
- f) exposure to sectors with high impact to climate change at least equivalent to the Parent Index;
- g) capped exposure to non-disclosing carbon companies;
- h) constituent-level weigh capping to address liquidity and diversification as defined in the methodology of the Index;
- i) reduced exposure to physical risks from climate change using Trucost's Physical Risk dataset as defined in the methodology of the Index;
- j) improved exposure to potential climate change opportunities through substantially higher green-to-brown revenue share; and
- k) reduced exposure to fossil fuel reserves.

The Index features exclusions for companies from the Parent Index with:

- i) controversial weapons, tobacco, small arms, military contracting, thermal coal, oil sands, shale energy, gambling and alcohol business activities based on revenue thresholds as defined in the methodology of the Index;
- ii) an impact on stakeholders deemed by Sustainalytics to be non-compliant with international norms ; and
- iii) public, ESG-related, controversial news (Media & Stakeholder Analysis or MSA) as defined in the methodology of the Index.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction of overall greenhouse gas emissions intensity compared to the Parent Index by at least 50%.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

The extra financial data coverage is at least 90% of the eligible equity securities of the Index. The Index features additional exclusions for companies that exceed derived revenue thresholds in coal/oil/natural gas exploration or processing activities and electricity generation subject to certain GHG intensities.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 35% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

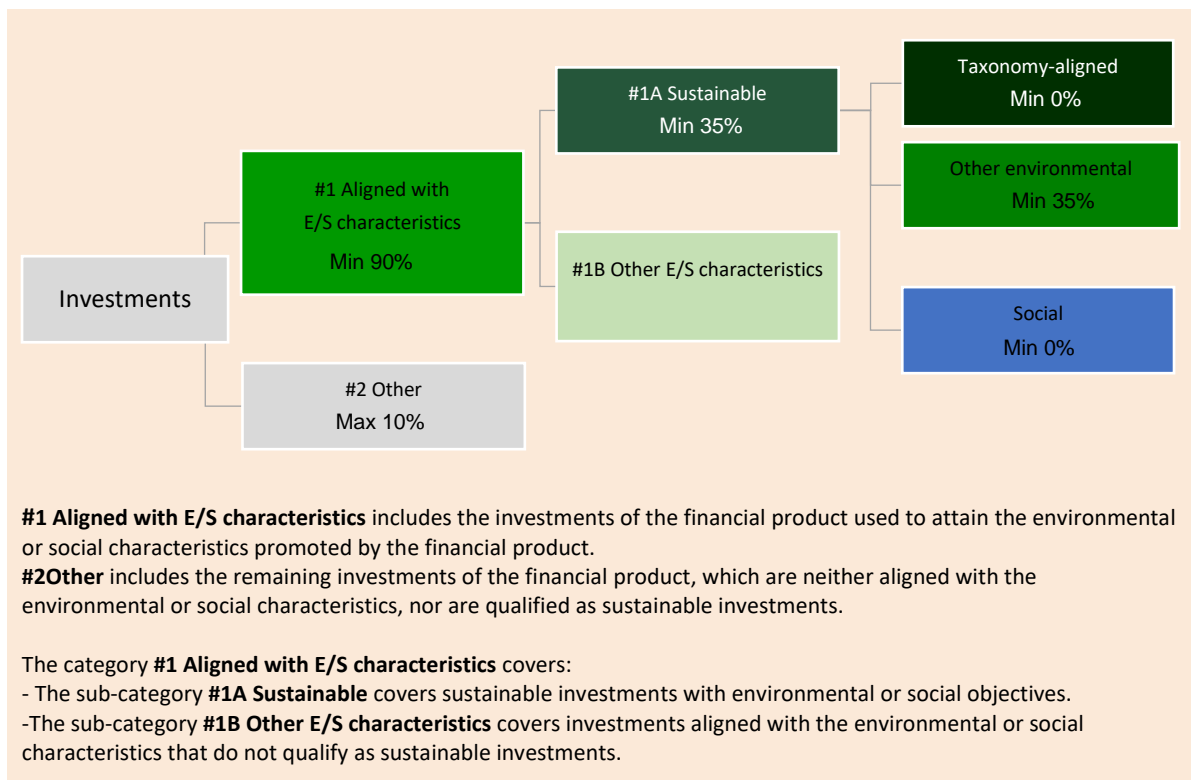
The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 35% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

The Sub-Fund currently has no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy. The Sub-Fund does not commit to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, it may invest in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

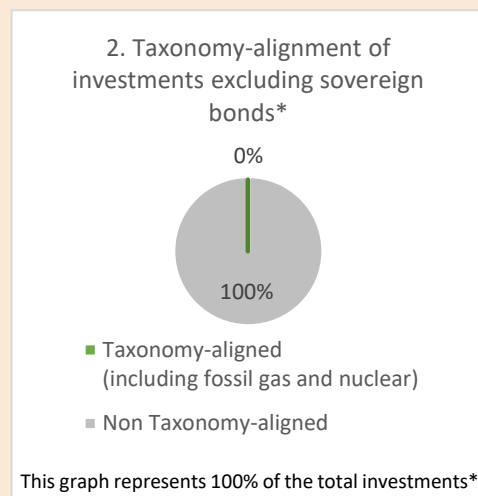
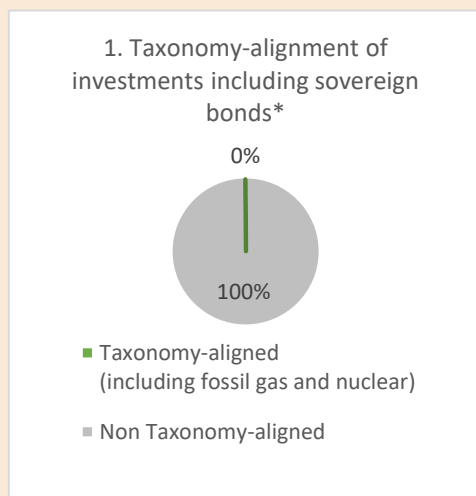
- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*




* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures

** This percentage is purely indicative and may vary.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.


 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 35% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.

 **What is the minimum share of socially sustainable investments?**

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.

 **What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?**

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index (the “Index”), denominated in Euros, and representative of the performance of eligible equity securities from the S&P Europe LargeMidCap Index (the “Parent Index”) selected and weighted to be collectively compatible with a 1.5°C global warming climate scenario.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.spglobal.com/spdji/en/index-family/esg/esg-climate/paris-aligned-climate-transition-pact/#overview>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 9, paragraphs 1 to 4a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 5, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name: Amundi Euro Government Green Bond

Legal entity identifier:
549300JJ88530HIOFM17

Sustainable investment objective

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not include a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Does this financial product have a sustainable investment objective?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Yes	<input type="radio"/> <input type="radio"/> No
<p><input checked="" type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: 90 %</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input checked="" type="checkbox"/> in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <p><input type="checkbox"/> It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: ___%</p>	<p><input type="checkbox"/> It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of ___% of sustainable investments</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input type="checkbox"/> with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy <input type="checkbox"/> with a social objective <p><input type="checkbox"/> It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments</p>



What is the sustainable investment objective of this financial product?

Sustainability indicators measure how the sustainable objectives of this financial product are attained.

The sub-fund is passively managed. Its investment objective is to replicate the Solactive Euro Government Green Bond Index (the "Index") which has the sustainable investment objective of being representative of the performance of investment grade rated Green Bonds issued by European Monetary Union countries. Green Bonds are issued in order to fund projects that have positive environmental outcomes.

More precisely, to be eligible for inclusion in the Index, a bond must be considered as a "Green Bond" by the Climate Bonds Initiative. Climate Bonds Initiative is an investor-focused not-for-profit organization promoting large-scale investments that will deliver a global low carbon and climate resilient economy (more information is available on the website: <http://www.climatebonds.net/>). Climate Bonds Initiative has developed and implemented the following set of criteria to define Green Bonds which are eligible for the Index:

i) Environmentally themed (self-labelled) bonds: to be eligible, green bonds must be publicly declared by their issuers as intended to be environmentally beneficial through labelling. Common

eligible labels include, but are not limited to, 'green', 'climate-awareness', 'climate', 'environmental', 'carbon', 'sustainability' and 'ESG' (Environment, Social, and Governance). The issuer must use the label or description in a public document for the label to be valid (e.g., in a press release, in a statement, in the bond prospectus or supporting bond offering documents).

ii) Eligible bond structures, which include:

- Asset-linked structures or 'use of proceeds' bonds, whereby proceeds raised by bond sale are earmarked for eligible green projects; and
- Asset-backed structures consisting in:
 - a. Project bonds, which are eligible if they are backed by a green project and the proceeds from bond sale are used solely to finance that same green project; and
 - b. Securitized bonds, which are eligible if proceeds go towards green projects or assets.

iii) Use of proceeds: issuers must commit to use proceeds from the bond sale in full (net of any bond arrangement fees) to finance eligible green projects or assets. For instance, bonds where more than 5% of the proceeds are used for 'general corporate purposes' or projects that are not defined as green, or bonds where proceeds are to be split across different projects (e.g., an ESG Bond with social projects and separate green projects) are not eligible for inclusion in the Index.

iv) Adherence with the "Climate Bonds Taxonomy": proceeds of an eligible green bond must be used to finance eligible green assets or projects which are typically related to one of the following sectors (as described in the Climate Bonds Taxonomy):

- Renewable and Alternative Energy;
- Energy efficiency;
- Low-Carbon Transport;
- Sustainable Water;
- Waste, recycling and pollution;
- Sustainable agriculture and forestry;
- Climate resilient infrastructure and climate adaptation.

As further described in the Climate Bonds Taxonomy, areas of the above sectors can be excluded (e.g. energy savings in fossil fuel extraction activities - for the energy efficiency category -, or the landfill without gas capture - for the waste category -) and related bonds are ineligible for inclusion in the Index.

More information can be found on the website: <http://www.climatebonds.net/> and <https://www.climatebonds.net/standard/taxonomy>.

● ***What sustainability indicators are used to measure the attainment of the sustainable investment objective of this financial product?***

Sustainability indicator used to measure the attainment of the sustainable investment objective of this financial product is the percentage of bonds considered as "Green Bond" by the climate bond initiative in the Index composition.

● ***How do sustainable investments not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

The eligible green bonds as selected under the product taxonomy cannot finance projects or assets from the following activities:

Energy:

- Uranium mining for nuclear power;
- Any fossil fuel-based power generation including gas, 'clean' coal and other coal.

Energy efficiency:

- Efficiency upgrades to GHG intensive power sources – e.g. cleaner coal technology;
- Energy savings in fossil fuel extraction activities - emission reduction requirements require a rapid phase out of all fossil fuel usage. Anything that helps to extend the life of fossil fuel usage is excluded.

Waste:

- Landfill without gas capture;
- Waste incineration without energy capture.

Transport:

- Rail lines where fossil fuels account for more than >50% of freight.

– How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?

The PAI 15 “GHG intensity” is taken into account through the exclusion in the Index of projects or assets from the following activities:

Energy:

- Uranium mining for nuclear power;
- Any fossil fuel-based power generation including gas, 'clean' coal and other coal.

Energy efficiency:

- Efficiency upgrades to GHG intensive power sources – e.g. cleaner coal technology;
- Energy savings in fossil fuel extraction activities - emission reduction requirements require a rapid phase out of all fossil fuel usage. Anything that helps to extend the life of fossil fuel usage is excluded.

Waste:

- Landfill without gas capture;
- Waste incineration without energy capture.

Transport:

- Rail lines where fossil fuels account for more than >50% of freight.

The PAI 16 “Investee countries subject to social violations” is taken into account through the exclusion from the sub-fund of countries on the European Union (EU) sanction list with a sanction consisting of asset freezing, and a sanction index at the highest level (considering both United States and EU sanctions), after formal review and validation from Amundi’s Rating Committee.

– How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights?

The sustainable investments considered are restricted to sovereign issuers. The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are not applicable for sovereigns.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the PAI 15 “GHG intensity” is taken into account through the exclusion in the Index of projects or assets from the following activities:

Energy:

- Uranium mining for nuclear power;
- Any fossil fuel-based power generation including gas, ‘clean’ coal and other coal.

Energy efficiency:

- Efficiency upgrades to GHG intensive power sources – e.g. cleaner coal technology;
- Energy savings in fossil fuel extraction activities - emission reduction requirements require a rapid phase out of all fossil fuel usage. Anything that helps to extend the life of fossil fuel usage is excluded.

Waste:

- Landfill without gas capture;
- Waste incineration without energy capture.

Transport:

- Rail lines where fossil fuels account for more than >50% of freight.

The PAI 16 “Investee countries subject to social violations” is taken into account through the exclusion from the sub-fund of countries on the European Union (EU) sanction list with a sanction consisting of asset freezing, and a sanction index at the highest level (considering both United States and EU sanctions), after formal review and validation from Amundi’s Rating Committee.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the Sub-Fund is to reflect the performance of the “Solactive Euro Government Green Bond Index” (the “Index”), while minimising the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Benchmark Index (the “Tracking Error”).

The Index is representative of the performance of investment grade rated Green Bonds issued by European countries and denominated in EUR. Green Bonds are issued in order to fund projects that have positive environmental outcomes.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain the sustainable investment objective?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

To be eligible for inclusion in the Index, a bond must be considered as a “Green Bond” by the Climate Bonds Initiative. Climate Bonds Initiative is an investor-focused not-for-profit organization promoting large-scale investments that will deliver a global low carbon and climate resilient economy (more information is available on the website: <http://www.climatebonds.net/>). Climate Bonds Initiative has developed and implemented the following set of criteria to define Green Bonds which are eligible for the Index:

i) Environmentally themed (self-labelled) bonds: to be eligible, green bonds must be publicly declared by their issuers as intended to be environmentally beneficial through labelling. Common eligible labels include, but are not limited to, ‘green’, ‘climate-awareness’, ‘climate’, ‘environmental’, ‘carbon’, ‘sustainability’ and ‘ESG’ (Environment, Social, and Governance). The issuer must use the

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

label or description in a public document for the label to be valid (e.g., in a press release, in a statement, in the bond prospectus or supporting bond offering documents).

ii) Eligible bond structures, which include:

- Asset-linked structures or 'use of proceeds' bonds, whereby proceeds raised by bond sale are earmarked for eligible green projects; and
- Asset-backed structures consisting in:
 - a. Project bonds, which are eligible if they are backed by a green project and the proceeds from bond sale are used solely to finance that same green project; and
 - b. Securitized bonds, which are eligible if proceeds go towards green projects or assets.

iii) Use of proceeds: issuers must commit to use proceeds from the bond sale in full (net of any bond arrangement fees) to finance eligible green projects or assets. For instance, bonds where more than 5% of the proceeds are used for 'general corporate purposes' or projects that are not defined as green, or bonds where proceeds are to be split across different projects (e.g., an ESG Bond with social projects and separate green projects) are not eligible for inclusion in the Index.

iv) Adherence with the "Climate Bonds Taxonomy": proceeds of an eligible green bond must be used to finance eligible green assets or projects which are typically related to one of the following sectors (as described in the Climate Bonds Taxonomy):

- Renewable and Alternative Energy;
- Energy efficiency;
- Low-Carbon Transport;
- Sustainable Water;
- Waste, recycling and pollution;
- Sustainable agriculture and forestry;
- Climate resilient infrastructure and climate adaptation.

As further described in the Climate Bonds Taxonomy, areas of the above sectors can be excluded (e.g. energy savings in fossil fuel extraction activities - for the energy efficiency category -, or the landfill without gas capture - for the waste category -) and related bonds are ineligible for inclusion in the Index.

More information can be found on the website: <http://www.climatebonds.net/> and <https://www.climatebonds.net/standard/taxonomy>.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

The Index is composed of sovereign issuers. The question is applicable for corporates.



Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

What is the asset allocation and the minimum share of sustainable investments?

The sub-fund commits to invest permanently at least 90% the net asset value of the Sub-Fund in Green Bonds comprising the Index (ie an EMU Government Green Bond)
 The Sub-Fund commits to have a minimum of 90% of sustainable investments as per the below chart. The Sustainable investment of the Sub Fund are supporting Environmental objective.

The planned proportion of other Environmental investment may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned investments increase.



● **How does the use of derivatives attain the sustainable investment objective?**

Derivatives are not used to attain the sustainable investment objective.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- **turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- **capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund currently has no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy. The Sub-Fund does not commit to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, it may invest in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

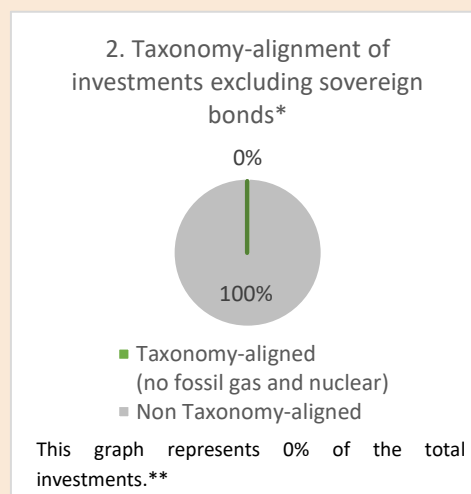
- **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

- Yes

 In fossil gas

 In nuclear energy
 No

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities



are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 90% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with a social objective?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Not sustainable”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

The investments are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. There are no minimum environmental or social safeguards for these assets.



Is a specific index designated as a reference benchmark to meet the sustainable investment objective?

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the sustainable investment objective.

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with its sustainable investment objective.

- ***How does the reference benchmark take into account sustainability factors in a way that is continuously aligned with the sustainable investment objective?***

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The Index is representative of the performance of investment grade rated Green Bonds issued by European countries and denominated in EUR. Green Bonds are issued in order to fund projects that have positive environmental outcomes.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

www.solactive.com



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Amundi Corporate Green Bond

Legal entity identifier:
549300DGW633M4IHL895

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 40% of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index composed of Green Bonds. To be eligible a bond must be considered as a “Green Bond” by the Climate Bonds Initiative.

Climate Bonds Initiative is an investor-focused- not-for-profit organization promoting large-scale investments that will deliver a global low carbon and climate resilient economy (more information is available on the website: <http://www.climatebonds.net/>). Climate Bonds Initiative has developed and implemented a set of criteria to define Green Bonds which are eligible for the Index.

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The use of proceeds of the bonds is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

More precisely, to be eligible for inclusion in the Solactive EUR USD IG Corporate Green Bond TR Index[®] (the "Index"), a bond must be considered as a "Green Bond" by the Climate Bonds Initiative.

Furthermore, the investment universe of the Index is based on the following criteria:

- a) The Index constituents must be constituents of the Solactive Green Bond EUR USD IG Index (the "Parent Index");
- b) ESG-value based exclusions from the following activities: controversial weapons, civilian firearms, adult entertainment, alcohol, gambling, genetic engineering, stem cell, tobacco, thermal coal. These exclusions are determined based on criteria and thresholds (e.g., maximum percentage of revenues related to these activities) which are further described in the Index methodology;
- c) Exclusion of issuers which are subject to UN Sanctions and/or "Non-Compliant" with regard to the Overall Global Compact Compliance.

Climate Bonds Initiative is an investor-focused not-for-profit organization promoting large-scale investments that will deliver a global low carbon and climate resilient economy (more information is available on the website: <http://www.climatebonds.net/>). Climate Bonds Initiative has developed and implemented the following set of criteria to define Green Bonds which are eligible for the Index:

- c) i) Environmentally themed (self-labelled) bonds: to be eligible, green bonds must be publicly declared by their issuers as intended to be environmentally beneficial through labelling. Common eligible labels include, but are not limited to, 'green', 'climate-awareness', 'climate', 'environmental', 'carbon', 'sustainability' and 'ESG' (Environment, Social, and Governance). The issuer must use the label or description in a public document for the label to be valid (e.g., in a press release, in a statement, in the bond prospectus or supporting bond offering documents).
- c) ii) Eligible bond structures, which include: asset-linked structures or 'use of proceeds' bonds, whereby proceeds raised by bond sale are earmarked for eligible green projects; and asset-backed structures consisting in (a) project bonds, which are eligible if they are backed by a green project and the proceeds from bond sale are used solely to finance that same green project; and (b) securitized bonds, which are eligible if proceeds go towards green projects or assets.
- c) iii) Use of proceeds: issuers must commit to use proceeds from the bond sale in full (net of any bond arrangement fees) to finance eligible green projects or assets. For instance, bonds where more than 5% of the proceeds are used for 'general corporate purposes' or projects that are not defined as green, or bonds where proceeds are to be split across different projects (e.g., an ESG Bond with social projects and separate green projects) are not eligible for inclusion in the Index.
- c) iv) Adherence with the "Climate Bonds Taxonomy": proceeds of an eligible green bond must be used to finance eligible green assets or projects which are typically related to one of the following sectors (as described in the Climate Bonds Taxonomy): Renewable and Alternative Energy, Energy efficiency, Low-Carbon Transport, Sustainable Water, Waste, recycling and pollution, Sustainable agriculture and forestry, Climate resilient infrastructure and climate adaptation

As further described in the Climate Bonds Taxonomy, areas of the above sectors can be excluded (e.g. energy savings in fossil fuel extraction activities - for the energy efficiency category -, or the landfill without gas capture - for the waste category -) and related bonds are ineligible for inclusion in the Index. More information can be found on the website: <http://www.climatebonds.net/> and <https://www.climatebonds.net/standard/taxonomy>.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that contributes to and has positive impacts on the energy and ecological transition by investing permanently at least 90% of the net asset value of the Sub-Fund in Green Bonds comprising the Index. Through its methodology and the manner it is constructed (as described above), the Index is aligned with the sustainable investment objective of the Sub-Fund and differs from a broad market index. Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Limits of the extra-financial approach” of the prospectus.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

- *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called “Community Involvement & Human Rights” which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that

relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and the downward evolution of the "Solactive EUR USD IG Corporate Green Bond TR Index" (the "Index") denominated in Euros, in order to offer an exposure to investment grade rated Green Bonds denominated in EUR and USD issued by companies, while minimising the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the "Tracking Error").

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

● **What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

To be eligible for inclusion in the Solactive EUR USD IG Corporate Green Bond TR Index" (the "Index"), a bond must be considered as a "Green Bond" by the Climate Bonds Initiative.

Furthermore, the investment universe of the Index is based on the following criteria:

- a) The Index constituents must be constituents of the Solactive Green Bond EUR USD IG Index (the "Parent Index");
- b) ESG-value based exclusions from the following activities: controversial weapons, civilian firearms, adult entertainment, alcohol, gambling, genetic engineering, stem cell, tobacco, thermal coal. These exclusions are determined based on criteria and thresholds (e.g., maximum percentage of revenues related to these activities) which are further described in the Index methodology;
- c) Exclusion of issuers which are subject to UN Sanctions and/or "Non-Compliant" with regard to the Overall Global Compact Compliance.

Climate Bonds Initiative is an investor-focused not-for-profit organization promoting large-scale investments that will deliver a global low carbon and climate resilient economy (more information is

available on the website: <http://www.climatebonds.net/>). Climate Bonds Initiative has developed and implemented the following set of criteria to define Green Bonds which are eligible for the Index:

c) i) Environmentally themed (self-labelled) bonds: to be eligible, green bonds must be publicly declared by their issuers as intended to be environmentally beneficial through labelling. Common eligible labels include, but are not limited to, 'green', 'climate-awareness', 'climate', 'environmental', 'carbon', 'sustainability' and 'ESG' (Environment, Social, and Governance). The issuer must use the label or description in a public document for the label to be valid (e.g., in a press release, in a statement, in the bond prospectus or supporting bond offering documents).

c) ii) Eligible bond structures, which include: asset-linked structures or 'use of proceeds' bonds, whereby proceeds raised by bond sale are earmarked for eligible green projects; and asset-backed structures consisting in (a) project bonds, which are eligible if they are backed by a green project and the proceeds from bond sale are used solely to finance that same green project; and (b) securitized bonds, which are eligible if proceeds go towards green projects or assets.

c) iii) Use of proceeds: issuers must commit to use proceeds from the bond sale in full (net of any bond arrangement fees) to finance eligible green projects or assets. For instance, bonds where more than 5% of the proceeds are used for 'general corporate purposes' or projects that are not defined as green, or bonds where proceeds are to be split across different projects (e.g., an ESG Bond with social projects and separate green projects) are not eligible for inclusion in the Index.

c) iv) Adherence with the "Climate Bonds Taxonomy": proceeds of an eligible green bond must be used to finance eligible green assets or projects which are typically related to one of the following sectors (as described in the Climate Bonds Taxonomy): Renewable and Alternative Energy, Energy efficiency, Low-Carbon Transport, Sustainable Water, Waste, recycling and pollution, Sustainable agriculture and forestry, Climate resilient infrastructure and climate adaptation

As further described in the Climate Bonds Taxonomy, areas of the above sectors can be excluded (e.g. energy savings in fossil fuel extraction activities - for the energy efficiency category -, or the landfill without gas capture - for the waste category -) and related bonds are ineligible for inclusion in the Index. More information can be found on the website: <http://www.climatebonds.net/> and <https://www.climatebonds.net/standard/taxonomy>.

The Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that contributes to and has positive impacts on the energy and ecological transition by investing permanently at least 90% of the net asset value of the Sub-Fund in Green Bonds comprising the Index. Through its methodology and the manner it is constructed (as described above), the Index is aligned with the sustainable investment objective of the Sub-Fund and differs from a broad market index. Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section "Limits of the extra-financial approach" of the prospectus.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● **What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?**

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 40% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 40% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

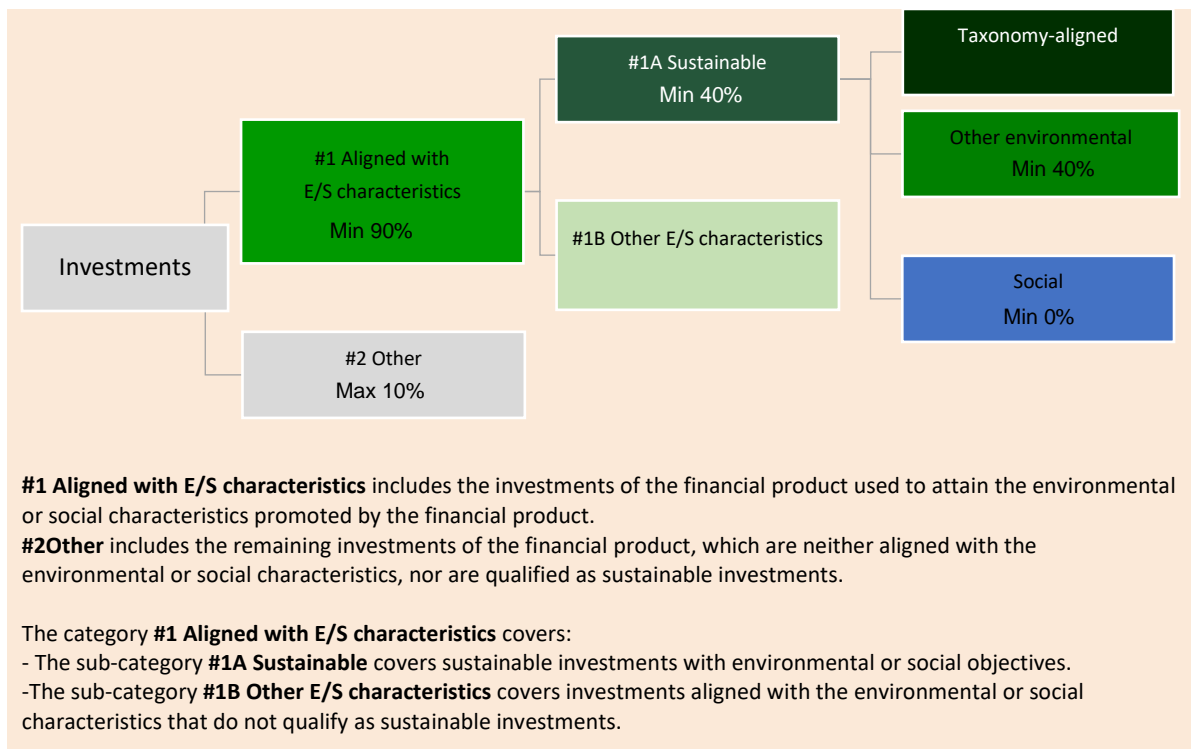
Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure

(CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are aligned with the EU Taxonomy.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

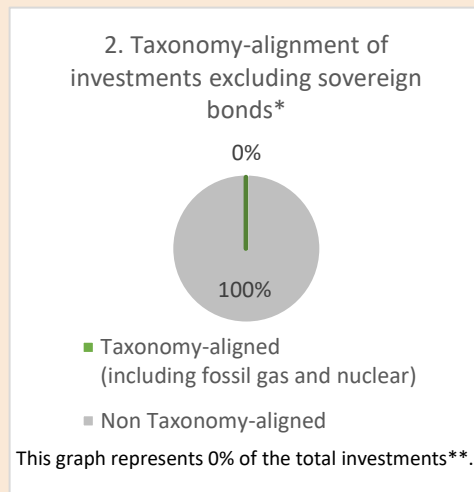
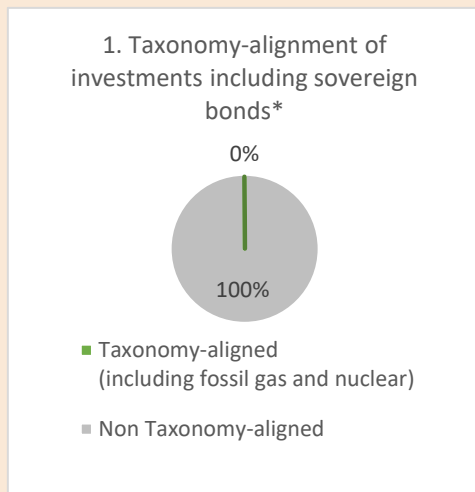
- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 ** This percentage is purely indicative and may vary.

- **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 40% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The “Solactive EUR USD IG Corporate Green Bond TR Index” (the “Index”) offers an exposure to investment grade rated Green Bonds denominated in EUR and USD issued by companies

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.solactive.com/indices/>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Product name:
Amundi MSCI Europe Climate Action

Legal entity identifier:
96950051YCAIOAMW7U51

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No



It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: ___%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: ___%



It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 5% of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index integrating a Climate Risk Management Score.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best-ranked companies are selected to construct the Index.

“Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Sustainability indicators

measure how the environmental or social characteristics promoted by the financial product are attained.

● **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

The MSCI "Climate Risk Management Weighted Average Score" is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

The MSCI Climate Risk Management Weighted Average Score is calculated using the following key issue management scores from MSCI ESG Ratings methodology related to management of Climate Change Risk and Environmental Opportunities:

- Carbon Emissions Management Score ;
- Product Carbon Footprint Management Score;
- Climate Change Vulnerability Management Score;
- Biodiversity and Land use Management Score;
- Opportunities in Clean Tech Management Score;
- Opportunities in Green Building Management Score;
- Opportunities in Renewable Energy Management Score.

More detailed on MSCI ESG Rating methodology can be found on the following link: <https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link: <https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>

More precisely, the MSCI Europe Climate Action Net Total Return Index (the "Index") is based on the MSCI Europe Index (the "Parent Index") and is representative of the performance of large and mid cap stocks, across developed European countries, issued by companies that have been assessed to lead their sector peers in terms of their positioning and actions relative to climate transition, based on, among others, the "Climate Risk Management Weighted Average Score", while minimizing the volatility of the difference between the return of the Index and the return of the Parent Index.

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI which features the following characteristics: 1) Eligible Universe

- a) Same investment universe as the the Parent Index;
- b) an ESG negative screening is performed on the investment universe as defined in the methodology in order to exclude:
 - companies with exposure to controversial business activities and which meet the business involvement exclusions criteria (as detailed in the methodology) such as: tobacco, nuclear weapons, thermal coal mining, oil sands extraction, controversial weapons;
 - companies involved in a very severe ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
 - securities which either have higher emission intensity than the high emission threshold as defined in the index methodology or do not yet have approved science-based targets;
 - companies which are in the lowest quartile of their GICS sector based on their Climate Risk Management Score.

2) Selection of companies in the index

Companies from the eligible universe are assigned to a quartile based on their Scope 1+2+3 Greenhouse Gas Intensity, Climate Management Weighted Average score, emissions reduction commitments, and their green business revenues.

Then securities are classified by descending order of float adjusted market capitalization.

Finally, for each GICS sector, securities are selected from the top by quartile until the number of selected

stocks correspond to 50% of the number of securities in the Parent Index. For more detail on this selection process please refer to the index methodology.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

- 1) follow best environmental and social practices; and
- 2) avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm (‘DNSH’), Amundi utilises two filters:

The first DNSH test filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company’s carbon intensity does not belong to the last decile of the sector).

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-

Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– *How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?*

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH filter relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO2 intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, The Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches.

- Exclusion: Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.

- Engagement: Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behavior of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories : to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- Vote: Amundi’s voting policy responds to an holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information please refer to Amundi’s Voting Policy .

- Controversies monitoring: Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the MULTI UNITS LUXEMBOURG – Amundi MSCI Europe Climate Action (the “Sub-Fund”) is to track both the upward and the downward evolution of the MSCI Europe Climate Action Net Total Return Index (the “Index”) denominated in Euros and representative of the performance of large and mid-cap stocks, across developed European countries, issued by companies that have been assessed to lead their sector peers in terms of their positioning and actions relative to climate transition, while minimizing the volatility of the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index (the “Tracking Error”).

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

The Sub-Fund is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

The Index is based on the Parent Index and includes large and mid-cap securities of the European developed equity market.

It aims to represent the performance of large and mid-cap stocks, across developed European countries, issued by companies that have been assessed to lead their sector peers in terms of their positioning and actions relative to climate transition while minimizing the volatility of the difference between the return of the Index and the return of the Parent Index. The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI which features the following characteristics:

1) Eligible Universe

- a) Same investment universe as the Parent Index);
- b) an ESG negative screening is performed on the investment universe as defined in the methodology in order to exclude:
 - companies with exposure to controversial business activities and which meet the business involvement exclusions criteria (as detailed in the methodology) such as: tobacco, nuclear weapons, thermal coal mining, oil sands extraction, controversial weapons;
 - companies involved in a very severe ESG controversy (based on the MSCI ESG Controversy score);
 - securities which either have higher emission intensity than the high emission threshold as defined in the index methodology or do not yet have approved science-based targets
 - companies which are in the lowest quartile of their GICS sector based on their Climate Risk Management Score (as defined in the methodology).

2) Selection of companies in the index

Companies from the eligible universe are assigned to a quartile based on their Scope 1+2+3 Greenhouse Gas Intensity, climate management weighted average score, emissions reduction commitments, and their green business revenues.

Then securities are classified by descending order of float adjusted market capitalization. Finally, for

each GICS sector, securities are selected from the top by quartile until the number of selected stocks correspond to 50% of the number of securities in the Parent Index. For more detail on this selection process please refer to the index methodology

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g., guaranteeing the issuer's value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer.

The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

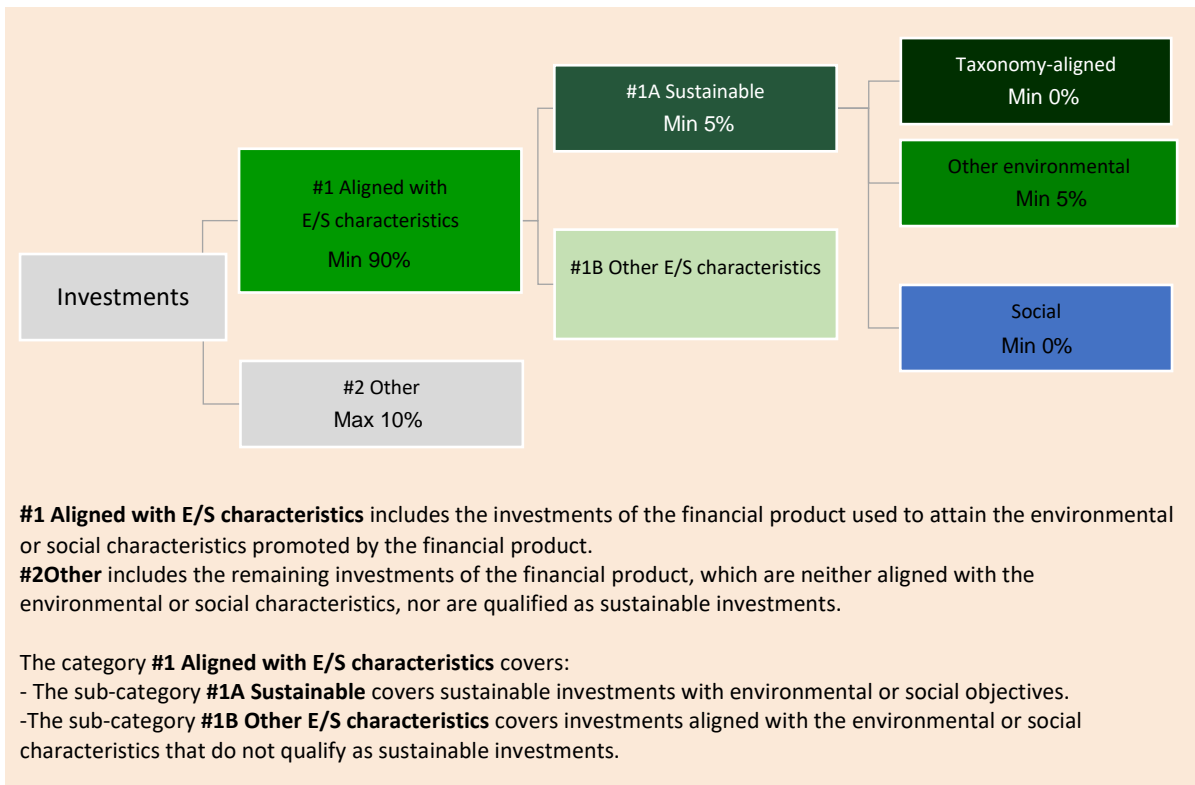
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's, securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 5% of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 5% and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund currently has no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy. The Sub-Fund does not commit to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, it may invest in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy¹ ?**

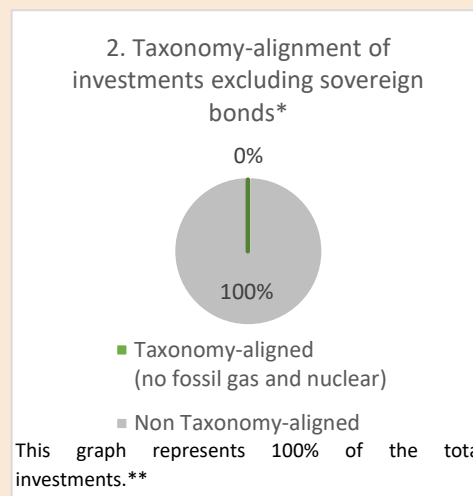
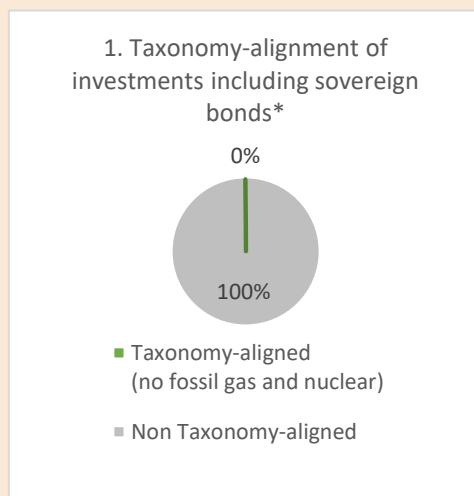
- Yes:
 - In fossil gas
 - In nuclear energy
- No

¹ Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.


The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.*



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures.
 **This percentage is purely indicative and may vary.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The funds has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 1% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 5% of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What investments are included under “#2 Other”, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The Index is denominated in Euros and representative of the performance of large and mid-cap stocks, across developed European countries, issued by companies that have been assessed to lead their sector peers in terms of their positioning and actions relative to climate transition.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at <https://www.msci.com/index-methodology>.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:
Amundi STOXX Europe 600 Energy ESG Screened

Legal entity identifier:

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No

X



It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective**: _____%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective**: _____%



It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 0 % of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating an Index "integrating an environmental, social and governance ("ESG") negative screening approach.

The negative screening approach consists in excluding at least 20% of companies from the parent index (expressed in number of constituents) based on:

- Controversial business activities
- ESG controversies
- An ESG rating if less than 20% of the parent index has been excluded based on controversial business activities and ESG controversies.

- **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the

financial product are attained.

The Sustainalytics ESG Risk Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product. The Sustainalytics ESG Risk Ratings (the "ESG score") measures a company's exposure to industry-specific material ESG risks and how well a company is managing those risks. Exposure refers to the extent to which a company is exposed to different material ESG issues. It takes into consideration subindustry and company-specific factors such as its business model. Management refers to how well a company is managing its relevant ESG issues. It assesses the robustness of a company's ESG programs, practices and policies. More precisely, the STOXX Europe 600 Energy ESG+ Index is constructed from the securities from the STOXX Europe 600 belonging to the ICB Energy Industry (the "Eligible Universe"). Then, the following filters apply:

- Companies that are non-compliant based on the ISS-ESG Norms Based Screening, as defined by ISS-ESG, assessment are excluded.
- Norms Based Screening identifies companies that violate or are at risk of violating commonly accepted international norms on human rights, labor standards, environmental protection and anti-corruption established in the UN Global Compact and the OECD Guidelines.
- Companies that ISS-ESG identified to be involved in Controversial Weapons are not eligible for selection.
- Additional exclusion filters are applied, screening companies for involvement in Tobacco, Thermal Coal, Unconventional Oil & Gas, Civilian Firearms, and Military Contracting, as defined by ISS-ESG.

If less than 20% of the companies belonging to the Eligible Universe are excluded by the screens above, the worst companies in terms of ESG performance, as defined by ISS-ESG, are excluded until the number of selected securities reaches 80% of the number of securities of the Eligible Universe. In case two companies have the same ESG Performance score, the company with the larger free-float market capitalization is selected.

The weighting of each stock in the Index is adjusted in line with its free-floating market capitalization. All components are subject to a 30% capping for the largest company and a 15% capping for the other remaining companies. An intra-quarter capping will be triggered if the largest company exceeds 35% or any other company exceeds 20%.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

1. follow best environmental and social practices; and
2. avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a "best performer" within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of "best performer" relies on Amundi's proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a "best performer", an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi's above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

- The first DNSH filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.
- Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO₂ intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights.
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example, the model has a dedicated criteria called “Community Involvement & Human Rights” which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts.

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

- Yes, the Sub-Fund considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the Sub-Fund’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches:
- **Exclusion:** Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.
 - **Engagement:** Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behaviour of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories: to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.
 - **Vote:** Amundi’s voting policy responds to a holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information, please refer to Amundi’s Voting Policy¹.
 - **Controversies monitoring:** Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG

¹ <https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646>

analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The investment objective of the Sub-Fund is to track the performance of the STOXX Europe 600 Energy ESG+ Index (the "Index"). The Index is an equity index that tracks the performance of the companies of the STOXX Europe 600 (which represents the 600 leading securities of European developed countries) belonging to the Energy Industry as determined by the Industry Classification Benchmark ("ICB") after a set of compliance, involvement and ESG performance screens are applied.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

● ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

The Index is constructed from the securities from the STOXX Europe 600 belonging to the Energy Industry as determined by the ICB. Then, the following filters apply:

- Companies that are non-compliant based on the ISS-ESG Norms Based Screening assessment are excluded.
- Norms Based Screening identifies companies that violate or are at risk of violating commonly accepted international norms on human rights, labor standards, environmental protection and anti-corruption established in the UN Global Compact and the OECD Guidelines.
- Companies that ISS-ESG identified to be involved in Controversial Weapons are not eligible for selection.
- Additional exclusion filters are applied, screening companies for involvement in Tobacco, Thermal Coal, Unconventional Oil & Gas, Civilian Firearms, and Military Contracting, as defined by ISS-ESG.

If less than 20% of the companies belonging to the Eligible Universe are excluded by the screens above, the worst companies in terms of ESG performance, as defined by ISS-ESG, are excluded until the number of selected securities reaches 80% of the number of securities of the Eligible Universe. In case two companies have the same ESG Performance score, the company with the larger free-float market capitalization is selected.

The weighting of each stock in the Index is adjusted in line with its free-floating market capitalization. All components are subject to a 30% capping for the largest company and a 15% capping for the other

remaining companies. An intra-quarter capping will be triggered if the largest company exceeds 35% or any other company exceeds 20%.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

To assess good governance practices of the investee companies, we rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g. guaranteeing the issuer's value over the long term).

The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy.

Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer. The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology, Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 0% of Sustainable Investments as per the below chart.

The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 0% and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

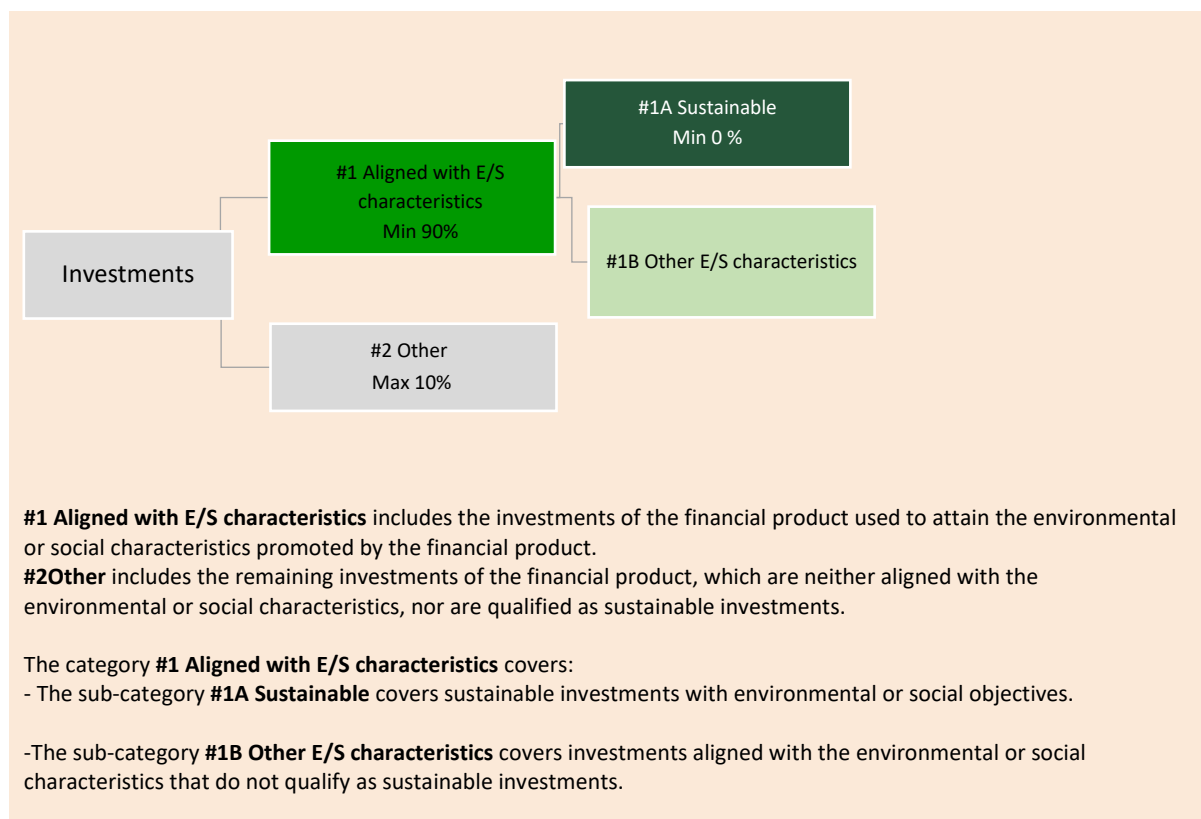
Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover
reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund currently has no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy.

The Fund does not commit to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, it may invest in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy² ?**

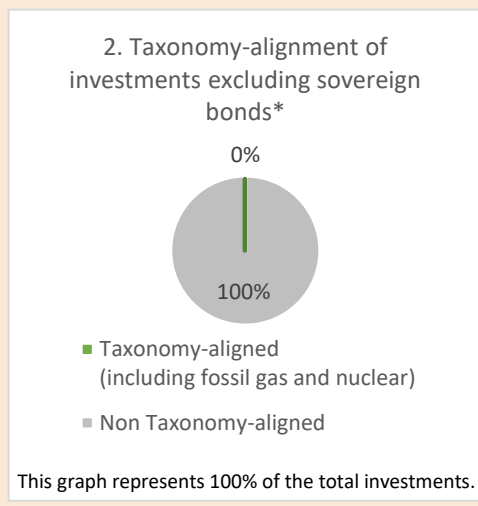
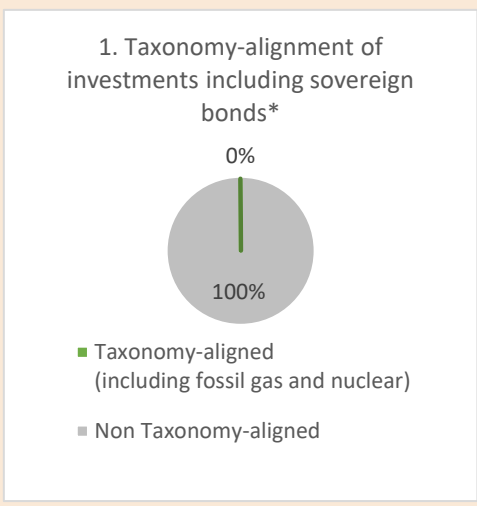
- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.


The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund has no minimum share of investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?”

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.

There are no minimum environmental or social safeguards.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

The Index is an equity index that tracks the performance of the companies of the STOXX Europe 600 (which represents the 600 leading securities of European developed countries) belonging to the Energy Industry as determined by the ICB after a set of compliance, involvement and ESG performance screens are applied.

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Additional information on the Index can be found at <https://www.qontigo.com/>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:
Amundi Global Gender Equality

Legal entity identifier:

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: _____%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: _____%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 30 % of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating the Index, integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index. “Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Sustainability indicators measure how the environmental or

- **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

social characteristics promoted by the financial product are attained.

The Equileap Gender Diversity Score is used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product. The Equileap Gender Diversity Score (the “**Equileap Score**”) is calculated based on criteria which are grouped in categories such as gender balance in leadership and workforce; equal compensation and worklife balance; policies promoting gender equality; commitment to transparency and accountability.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

More precisely, the starting universe is made of all securities belonging to one of the below Solactive benchmarks:

- Solactive GBS Developed Markets Large&Mid Cap Index
- Solactive Europe 600 Index
- Solactive GBS United States 1000 Index

To be included in the Index, components need to pass:

- Standard liquidity criteria: Minimum market capitalization and average daily value traded thresholds;
- A light ESG screening: exclusion of companies with exposure to activities such as Gambling, Adult Entertainment, Alcoholic Beverages, Tobacco Products, Military Equipment, Nuclear Energy and Unconventional Fossil Fuels. Companies with verified infringement of established international initiatives and guidelines (such as UN Principles and OECD Guidelines) are also excluded.
- An additional ESG screening applied by Equileap, a leading expert in gender equality research which provides gender-related data on companies: screen out of companies which have engaged in known unethical business practices in the last 2 years.
- An in-depth gender equality screening as defined by Equileap: companies are ranked according to the Equileap Score.

Index constituents are selected according to their Equileap Score , based on a “Best-in-class” approach. “Best-inclass” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class.

Such process results in selecting the top 150 companies, including at least 50% of US listed companies and a maximum of 10% for any other country.

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

1. follow best environmental and social practices; and
2. avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi’s above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm (‘DNSH’), Amundi utilises two filters:

- The first DNSH filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company’s carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi’s Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.
- Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi’s ESG rating.

– ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO₂ intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors),

- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector,
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights, and
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution.

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example, the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts.

The EU Taxonomy sets out a "do not significant harm" principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The "do no significant harm" principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?



Yes, the financial product considers all the mandatory Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the financial product's strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), ESG rating integration into the investment process, engagement and voting approaches:

- **Exclusion:** Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.
- **ESG factors integration:** Amundi has adopted minimum ESG integration standards applied by default to its actively managed open-ended funds (exclusion of G rated issuers and better weighted average ESG score higher than the applicable benchmark). The 38 criteria used in Amundi ESG rating approach were also designed to consider key impacts on sustainability factors,

as well as quality of the mitigation undertaken are also considered in that respect.

- **Engagement:** Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behaviour of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories: to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.
- **Vote:** Amundi's voting policy responds to a holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information, please refer to Amundi's Voting Policy¹.
- **Controversies monitoring:** Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund objective is to track the performance of Solactive Equileap Global Gender Equality Index (the "Index"), and to minimize the tracking error between the net asset value of the sub-fund and the performance of the Index.

This Index is an equity index that provides exposure to the leading companies in the fields of gender equality where components meet ESG requirements as further described in this Appendix I – ESG Related Disclosures to the Sub-Fund's Prospectus.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

¹ <https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646>

More precisely, the starting universe is made of all securities belonging to one of the below Solactive benchmarks:

- Solactive GBS Developed Markets Large&Mid Cap Index
- Solactive Europe 600 Index
- Solactive GBS United States 1000 Index

To be included in the Index, components need to pass:

-Standard liquidity criteria: Minimum market capitalization and average daily value traded thresholds;

-A light ESG screening: exclusion of companies with exposure to activities such as Gambling, Adult Entertainment, Alcoholic Beverages, Tobacco Products, Military Equipment, Nuclear Energy and Unconventional Fossil Fuels. Companies with verified infringement of established international initiatives and guidelines (such as UN Principles and OECD Guidelines) are also excluded.

-An additional ESG screening applied by Equileap, a leading expert in gender equality research which provides gender-related data on companies: screen out of companies which have engaged in known unethical business practices in the last 2 years.

-An in-depth gender equality screening as defined by Equileap: companies are ranked according to the Equileap Score.

Index constituents are selected according to their Equileap Score, based on a “Best-in-class” approach. “Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Such process results in selecting the top 150 companies, including at least 50% of US listed companies and a maximum of 10% for any other country.

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

We rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi’s ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer’s ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g. guaranteeing the issuer’s value over the long term). The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders’ rights, ethics, tax practices and ESG strategy.

Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer. The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi’s ESG ratings Committee monthly reviews lists

of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation describes the share of investments in specific assets.

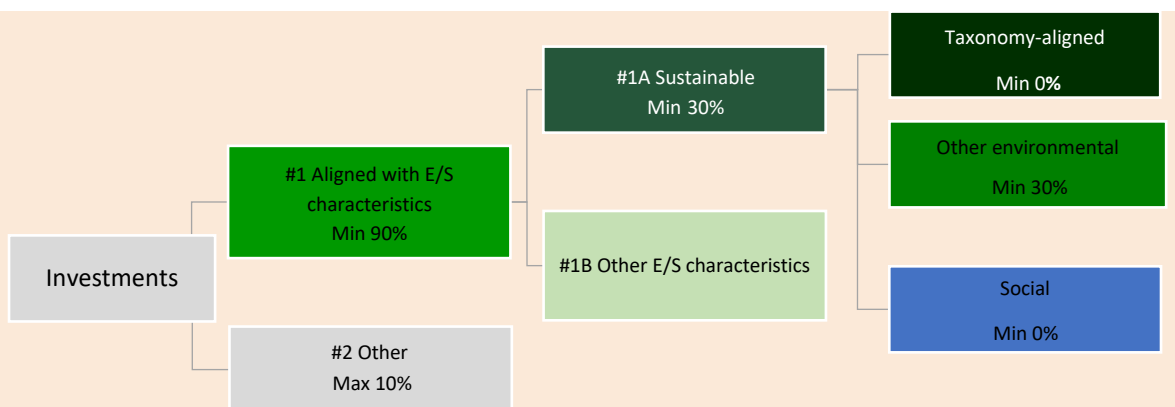
At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 30 % of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A). The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 30 % and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



#1 Aligned with E/S characteristics includes the investments of the financial product used to attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product.

#2Other includes the remaining investments of the financial product, which are neither aligned with the environmental or social characteristics, nor are qualified as sustainable investments.

The category **#1 Aligned with E/S characteristics** covers:

- The sub-category **#1A Sustainable** covers sustainable investments with environmental or social objectives.

-The sub-category **#1B Other E/S characteristics** covers investments aligned with the environmental or social characteristics that do not qualify as sustainable investments.

- **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

There is currently no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy.

There is no commitment to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, investments may be done in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

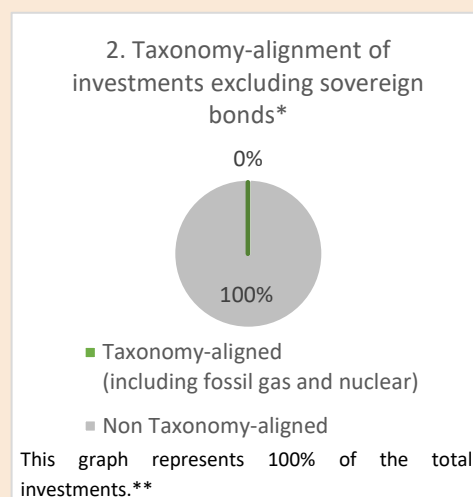
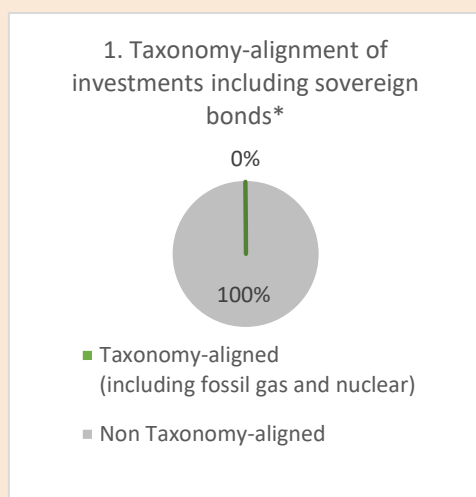
● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy² ?**

- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.




* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 **This percentage is purely indicative and may vary.

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

There is no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 30 % of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.

There are no minimum environmental or social safeguards.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index Solactive Equileap Global Gender Equality Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

● **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

Solactive Equileap Global Gender Equality Index is an equity index that provides exposure to the leading companies in the fields of gender equality where components meet ESG requirements.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at: www.solactive.com.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at www.amundiETF.com.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:
Amundi MSCI Digital Economy ESG Screened

Legal entity identifier:

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: _____%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: _____%

It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 15 % of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through, among others, replicating the Index integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index. “Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

- **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

Sustainability indicators measure how the environmental or social characteristics promoted by the

financial product are attained.

The MSCI ESG Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

More detailed on MSCI ESG Rating can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/34424357/MSCI+ESG+Ratings+Methodology+%28002%29.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>

More precisely, the MSCI ACWI IMI Digital Economy & Metaverse ESG Filtered objective is to measure the performance of companies that are expected to derive significant revenues from the digital economy value chain including the metaverse ecosystem, after excluding companies which are ESG laggards relative to the theme universe.

It selects companies which are assessed to have high exposure to business activities such as:

- Metaverse Ecosystem (e.g. Digital Payments, Blockchain, Artificial Intelligence)
- Cybersecurity
- Cloud Computing
- Robots and Automation
- Sharing Economy

The Index features the following characteristics:

- a) Same investment universe as the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "**Parent Index**"); i.e. including large, mid and small cap stocks across developed and emerging countries.
- b) A set of relevant words and phrases derived from the above business activities is used to identify companies (the "**Eligible Universe**") which could benefit from the increased adoption and utilization of products and services focused on digital technology.
- c) Companies from the Eligible Universe with a "**Relevance Score**" (as defined by MSCI) above 25% constitute the "Selected Universe".
- d) Further liquidity/size/country/sectorial filters are applied to the Selected Universe.
- e) An ESG negative screening is performed on the Selected Universe as defined in the methodology in order to exclude:
 - Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of UN Global Compact; and
 - Companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI).
- f) filtered universe is constructed using a "Best-in-class" approach (the "**Filtered Universe**"): bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the filtered Selected Universe.

“Best-in-class” approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company’s resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company’s core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers). Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Principal risks” of the Sub-Fund’s prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Parent Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

- g) The top half in terms of Relevance Score of the Filtered Universe constitutes the Index composition.
- h) The Index is weighted in proportion of an aggregate score combining the normalized value of three fundamental criteria: the percentage of sales spent on R&D and capex, return on invested capital and one year sales growth.
- i) An iterative downweighing ensure that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the MSCI ACWI IMI Digital Economy Index.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

1. follow best environmental and social practices; and
2. avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions

and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi's above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

- The first DNSH filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.
- Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO₂ intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors), and
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector, and
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights, and
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution.

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the

tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example, the model has a dedicated criteria called “Community Involvement & Human Rights” which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts.

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the financial product considers all the mandatory Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the financial product’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), ESG rating integration into the investment process, engagement and voting approaches:

- **Exclusion:** Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.
- **ESG factors integration:** Amundi has adopted minimum ESG integration standards applied by default to its actively managed open-ended funds (exclusion of G rated issuers and better weighted average ESG score higher than the applicable benchmark). The 38 criteria used in Amundi ESG rating approach were also designed to consider key impacts on sustainability factors, as well as quality of the mitigation undertaken are also considered in that respect.
- **Engagement:** Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behaviour of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories: to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human

rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- **Vote:** Amundi's voting policy responds to a holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information, please refer to Amundi's Voting Policy¹.
- **Controversies monitoring:** Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund objective is to track the performance of MSCI ACWI IMI Digital Economy & Metaverse ESG Filtered Index ("the Index"), and to minimize the tracking error between the net asset value of the sub-fund and the performance of the Index.

The Index aims to represent the performance of companies that are expected to derive significant revenues from the digital economy value chain including the metaverse ecosystem and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance ("ESG") laggards relative to the theme universe.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

MSCI ACWI IMI Digital Economy & Metaverse ESG Filtered objective is to measure the performance of companies that are expected to derive significant revenues from the digital economy value chain including the metaverse ecosystem, after excluding companies which are ESG laggards relative to the theme universe. The Index is constructed by selecting stocks from the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "**Parent Index**").

It selects companies which are assessed to have high exposure to business activities such as:

- Metaverse Ecosystem (e.g. Digital Payments, Blockchain, Artificial Intelligence)
- Cybersecurity
- Cloud Computing
- Robots and Automation

¹ <https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646>

- Sharing Economy

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI.

The Index features the following characteristics:

- a) Same investment universe as the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "Parent Index"); i.e. including large, mid and small cap stocks across developed and emerging countries.
- b) A set of relevant words and phrases derived from the above business activities is used to identify companies (the "Eligible Universe") which could benefit from the increased adoption and utilization of products and services focused on digital technology.
- c) Companies from the Eligible Universe with a "Relevance Score" (as defined by MSCI) above 25% constitute the "Selected Universe".
- d) Further liquidity/size/country/sectorial filters are applied to the Selected Universe.
- e) An ESG negative screening is performed on the Selected Universe as defined in the methodology in order to exclude:
 - Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of UN Global Compact; and
 - Companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI).
- f) Filtered universe is constructed using a "Best-in-class" approach (the "Filtered Universe"): bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the filtered Selected Universe.

"Best-in-class" approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company.

The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics. Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers). Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section "Principal risks" of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Parent Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

- g) The top half in terms of Relevance Score of the Filtered Universe constitutes the Index composition.
- h) The Index is weighted in proportion of an aggregate score combining the normalized value of three fundamental criteria: the percentage of sales spent on R&D and capex, return on invested capital and one year sales growth.
- i) An iterative downweighing ensure that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the MSCI ACWI IMI Digital Economy Index.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

● ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

● ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

We rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g. guaranteeing the issuer's value over the long term) The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer. The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 15 % of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with

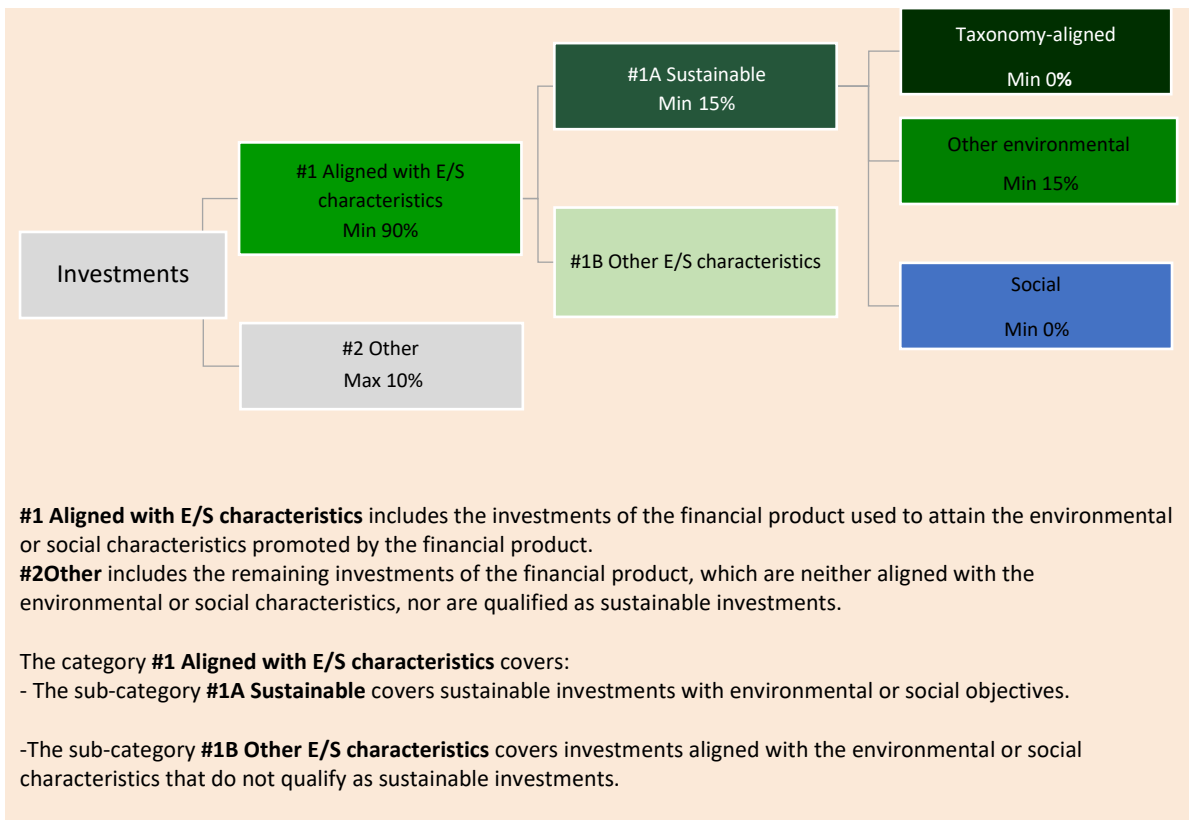
Asset allocation describes the share

of investments in specific assets.

other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A). The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 15 % (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover** reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure** (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- **operational expenditure** (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.

🌍 **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

There is currently no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy.

There is no commitment to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, investments may be done in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

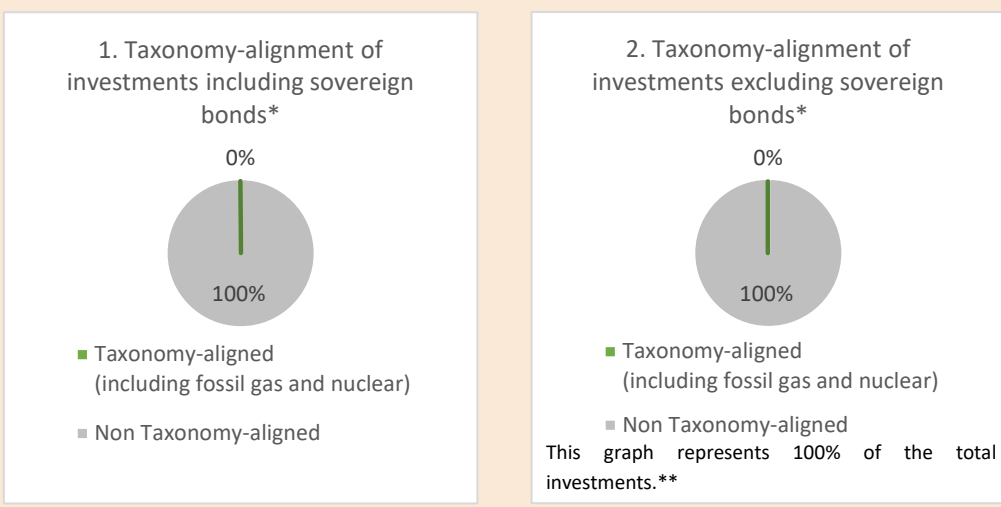
● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy² ?**

- Yes:
 In fossil gas In nuclear energy
- No

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 **This percentage is purely indicative and may vary.


● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

There is no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 15 % of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.

What is the minimum share of socially sustainable investments?



The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.

There are no minimum environmental or social safeguards.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the MSCI ACWI IMI Digital Economy & Metaverse ESG Filtered Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The Index aims to represent the performance of companies that are expected to derive significant revenues from the digital economy value chain including the metaverse ecosystem and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance (“ESG”) laggards relative to the theme universe.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at : <https://www.msci.com/>

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at <https://www.amundiETF.com>.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:
Amundi MSCI Disruptive Technology ESG Screened

Legal entity identifier:

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective:** _____%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective:** _____%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 20 % of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating the Index integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index. “Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

- **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

Sustainability indicators measure how the environmental or

social characteristics promoted by the financial product are attained.

The MSCI ESG Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

More detailed on MSCI ESG Rating can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/34424357/MSCI+ESG+Ratings+Methodology+%28002%29.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>

More precisely, the MSCI ACWI IMI Disruptive Technology ESG Filtered objective is to measure the performance of companies aligned to themes commonly associated with or described as disruptive technology after excluding companies which are ESG laggards relative to the theme universe. It selects companies which are assessed to have high exposure to business activities such as:

- 3D Printing
- Internet of Things
- Cloud Computing
- Fintech
- Digital Payments
- Healthcare Innovation
- Robotics
- Cybersecurity
- Clean Energy and Smart Grids.

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI.

The Index features the following characteristics:

- a) Same investment universe as the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "**Parent Index**"); i.e. including large, mid and small cap stocks across developed and emerging countries.
- b) A set of relevant words and phrases derived from the above business activities is used to identify companies (the "**Eligible Universe**") aligned to themes commonly associated with or described as "disruptive technology".
- c) Companies from the Eligible Universe with a "**Relevance Score**" (as defined by MSCI) above 25% constitutes the "**Selected Universe**".
- d) Further liquidity/size/country/sectorial filters are applied to the Selected Universe.
- e) An ESG negative screening is performed on the Selected Universe as defined in the methodology in order to exclude:
 - Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of UN Global Compact; and
 - Companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI).

f) A Filtered Universe is constructed using a “Best-in-class” approach (the “**Filtered Universe**”): bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the filtered Selected Universe. “Best-in-class” approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company’s resilience to longterm, industry material ESG risks.

It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company’s core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

Using such Best-in-class approach, the Sub- Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Principal risks” of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Parent Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

g) The top half in terms of Relevance Score of the Filtered Universe constitutes the Index composition.

h) The Index is weighted in proportion of an aggregate score combining the normalized value of three fundamental criteria: the percentage of sales spent on R&D and capex, return on invested capital and one year sales growth.

i) An iterative downweighing ensure that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the MSCI ACWI IMI Disruptive Technology Index.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundi-etf.com/>.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

1. follow best environmental and social practices; and
2. avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis

of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi's above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

- The first DNSH filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.
- Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO₂ intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors),
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector,
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights, and
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution.

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example, the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts.

The EU Taxonomy sets out a "do not significant harm" principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The "do no significant harm" principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

1 Yes, the financial product considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table of the RTS applying to the financial product's strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches:

- **Exclusion:** Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.
- **Engagement:** Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behaviour of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories: to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.
- **Vote:** Amundi's voting policy responds to a holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information, please refer to Amundi's Voting Policy¹.

1 <https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646>

- **Controversies monitoring:** Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund objective is to track the performance of MSCI ACWI IMI Disruptive Technology ESG Filtered Index (“the Index”), and to minimize the tracking error between the net asset value of the sub-fund and the performance of the Index.

The Index aims to represent the performance of companies aligned to themes commonly associated with or described as disruptive technology and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance (“ESG”) laggards relative to the theme universe.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

MSCI ACWI IMI Disruptive Technology ESG Filtered objective is to measure the performance of companies aligned to themes commonly associated with or described as disruptive technology after excluding companies which are Environmental, Social and Governance (“ESG”) laggards relative to the theme universe. The Index is constructed by selecting stocks from the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the “Parent Index”).

It selects companies which are assessed to have high exposure to business activities such as:

- 3D Printing
- Internet of Things
- Cloud Computing
- Fintech
- Digital Payments
- Healthcare Innovation
- Robotics
- Cybersecurity
- Clean Energy and Smart Grids.

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI.

The Index features the following characteristics:

a) Same investment universe as the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "Parent Index"); i.e. including large, mid and small cap stocks across developed and emerging countries.

b) A set of relevant words and phrases derived from the above business activities is used to identify companies (the "Eligible Universe") aligned to themes commonly associated with or described as "disruptive technology".

c) Companies from the Eligible Universe with a "Relevance Score" (as defined by MSCI) above 25% constitutes the "Selected Universe".

d) Further liquidity/size/country/sectorial filters are applied to the Selected Universe.

e) An ESG negative screening is performed on the Selected Universe as defined in the methodology in order to exclude:

- Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of UN Global Compact; and

- Companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI).

f) A Filtered Universe is constructed using a "Best-in-class" approach (the "Filtered Universe"): bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the filtered Selected Universe. "Best-in-class" approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers). Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section "Principal risks" of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Parent Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

g) The top half in terms of Relevance Score of the Filtered Universe constitutes the Index composition.

h) The Index is weighted in proportion of an aggregate score combining the normalized value of three fundamental criteria: the percentage of sales spent on R&D and capex, return on invested capital and one year sales growth.

i) An iterative downweighing ensure that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the MSCI ACWI IMI Disruptive Technology Index.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorial) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance

practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

We rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g. guaranteeing the issuer's value over the long term) The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy.

Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer. The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

Asset allocation

describes the share of investments in specific assets.

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 20 % of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A).

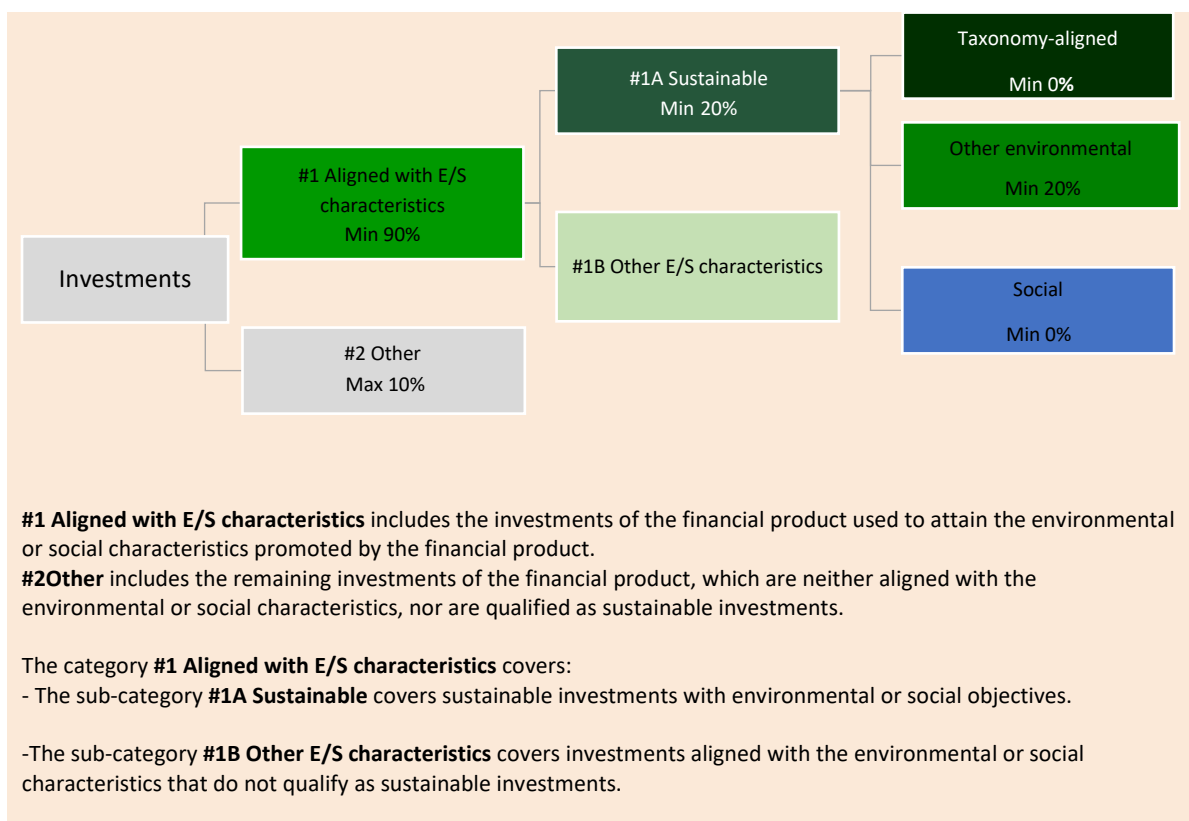
The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 20% (i) and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

-turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies

-capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.

- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.



To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?

There is currently no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy.

There is no commitment to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, investments may be done in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy² ?**

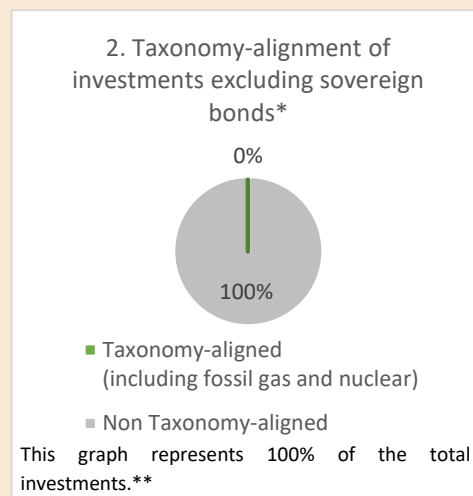
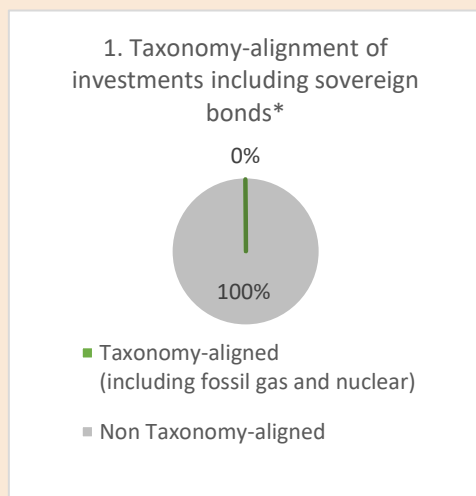
- Yes:
- In fossil gas In nuclear energy
- No

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.


The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 **This percentage is purely indicative and may vary.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

There is no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 20 % of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.

There are no minimum environmental or social safeguards.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

- **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

The investment objective of the financial product is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the financial product and the return of the Index.

- **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

The Index aims to represent the performance of companies aligned to themes commonly associated with or described as disruptive technology and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance (“ESG”) laggards relative to the theme universe.

- **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Additional information on the Index can be found at : <https://www.msci.com/>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at <https://www.amundiETF.com>.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:
Amundi MSCI Future Mobility ESG Screened

Legal entity identifier:

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?

Yes

No

It will make a minimum of **sustainable investments with an environmental objective:** _____%

in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

It will make a minimum of **sustainable investments with a social objective:** _____%

It **promotes Environmental/Social (E/S) characteristics** and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 20 % of sustainable investments

with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy

with a social objective

It promotes E/S characteristics, but **will not make any sustainable investments**

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating the Index integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index. “Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

- **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

Sustainability indicators measure how the environmental or

social characteristics promoted by the financial product are attained.

The MSCI ESG Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

More detailed on MSCI ESG Rating can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/34424357/MSCI+ESG+Ratings+Methodology+%28002%29.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>

More precisely, the MSCI ACWI IMI Future Mobility ESG Filtered Index objective is to measure the performance of companies which are expected to derive significant revenues from energy storage technologies, autonomous vehicles, shared mobility and new transportation methods after excluding companies which are ESG laggards relative to the theme universe.

It selects companies which are assessed to have high exposure to business activities such as:

- Electro-chemical energy storage technologies;
- Mining companies that produce metals used to manufacture batteries;
- Autonomous vehicles and related technologies;
- Electric vehicles ("EVs"), and EV components and materials;
- New transportation methods, passenger and freight, including electric vehicles, autonomous vehicle;
- Shared mobility (Sharing Economy).

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI. The Index features the following characteristics:

- a) Same investment universe as the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "Parent Index"); i.e. including large, mid and small cap stocks across developed and emerging countries.
- b) A set of relevant words and phrases derived from the above business activities is used to identify companies (the "Eligible Universe") engaged in the production of electric and autonomous vehicles or their components, battery technologies and battery metals, and sharing economy including ridesharing and micro mobility.
- c) Companies from the Eligible Universe with a "Relevance Score" (as defined by MSCI) above 25% constitute the "Selected Universe".
- d) Further liquidity/size/country/sectorial filters are applied to the Selected Universe.
- e) An ESG negative screening is performed on the Selected Universe as defined in the methodology in order to exclude:
 - Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of UN Global Compact; and
 - Companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI).

- f) A Filtered Universe is constructed using a “Best-in-class” approach (the “Filtered Universe”): bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the filtered Selected Universe.

“Best-in-class” approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company’s resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company’s core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company.

The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers). Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Principal risks” of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Parent Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

- g) The top half in terms of Relevance Score of the Filtered Universe constitutes the Index composition.
- h) The Index is weighted in proportion of an aggregate score combining the normalized value of three fundamental criteria: the percentage of sales spent on R&D and capex, return on invested capital and one year sales growth.
- i) An iterative downweighing ensure that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the MSCI ACWI IMI Future Mobility Index.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

1. follow best environmental and social practices; and
2. avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going

from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi's above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

- The first DNSH filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.
- Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO₂ intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors),
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector,
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights, and

- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution.

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

- *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example, the model has a dedicated criteria called "Community Involvement & Human Rights" which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts.

The EU Taxonomy sets out a "do not significant harm" principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The "do no significant harm" principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

1 Yes, the financial product considers Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table of the RTS applying to the financial product's strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), engagement and voting approaches:

- **Exclusion:** Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.
- **Engagement:** Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behaviour of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories: to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- **Vote:** Amundi’s voting policy responds to a holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information, please refer to Amundi’s Voting Policy¹.
- **Controversies monitoring:** Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi’s funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund objective is to track the performance of MSCI ACWI IMI Future Mobility ESG Filtered Index (“the Index”), and to minimize the tracking error between the net asset value of the sub-fund and the performance of the Index.

The Index aims to represent the performance of companies that are expected to derive significant revenues from energy storage technologies, autonomous vehicles, shared mobility and new transportation methods and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance (“ESG”) laggards relative to the theme universe.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- ***What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?***

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

MSCI ACWI IMI Future Mobility ESG Filtered Index objective is to measure the performance of companies which are expected to derive significant revenues from energy storage technologies, autonomous vehicles, shared mobility and new transportation methods after excluding companies which are Environmental, Social and Governance (“ESG”) laggards relative to the theme universe. The Index is constructed by selecting stocks from the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the “Parent Index”).

It selects companies which are assessed to have high exposure to business activities such as:

- Electro-chemical energy storage technologies;
- Mining companies that produce metals used to manufacture batteries;
- Autonomous vehicles and related technologies;
- Electric vehicles (“EVs”), and EV components and materials;
- New transportation methods, passenger and freight, including electric vehicles, autonomous vehicle;
- Shared mobility (Sharing Economy).

¹ <https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646>

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI. The Index features the following characteristics:

- a) Same investment universe as the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "Parent Index"); i.e. including large, mid and small cap stocks across developed and emerging countries.
- b) A set of relevant words and phrases derived from the above business activities is used to identify companies (the "Eligible Universe") engaged in the production of electric and autonomous vehicles or their components, battery technologies and battery metals, and sharing economy including ridesharing and micro mobility.
- c) Companies from the Eligible Universe with a "Relevance Score" (as defined by MSCI) above 25% constitute the "Selected Universe".
- d) Further liquidity/size/country/sectorial filters are applied to the Selected Universe.
- e) An ESG negative screening is performed on the Selected Universe as defined in the methodology in order to exclude:
 - Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of UN Global Compact; and
 - Companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI).
- f) A Filtered Universe is constructed using a "Best-in-class" approach (the "Filtered Universe"): bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the filtered Selected Universe.

"Best-in-class" approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company.

The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers). Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section "Principal risks" of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Parent Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

- g) The top half in terms of Relevance Score of the Filtered Universe constitutes the Index composition.
- h) The Index is weighted in proportion of an aggregate score combining the normalized value of three fundamental criteria: the percentage of sales spent on R&D and capex, return on invested capital and one year sales growth.

- i) An iterative downweighing ensure that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the MSCI ACWI IMI Future Mobility Index.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

We rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g. guaranteeing the issuer's value over the long term) The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy. Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer. The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 20 % of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with

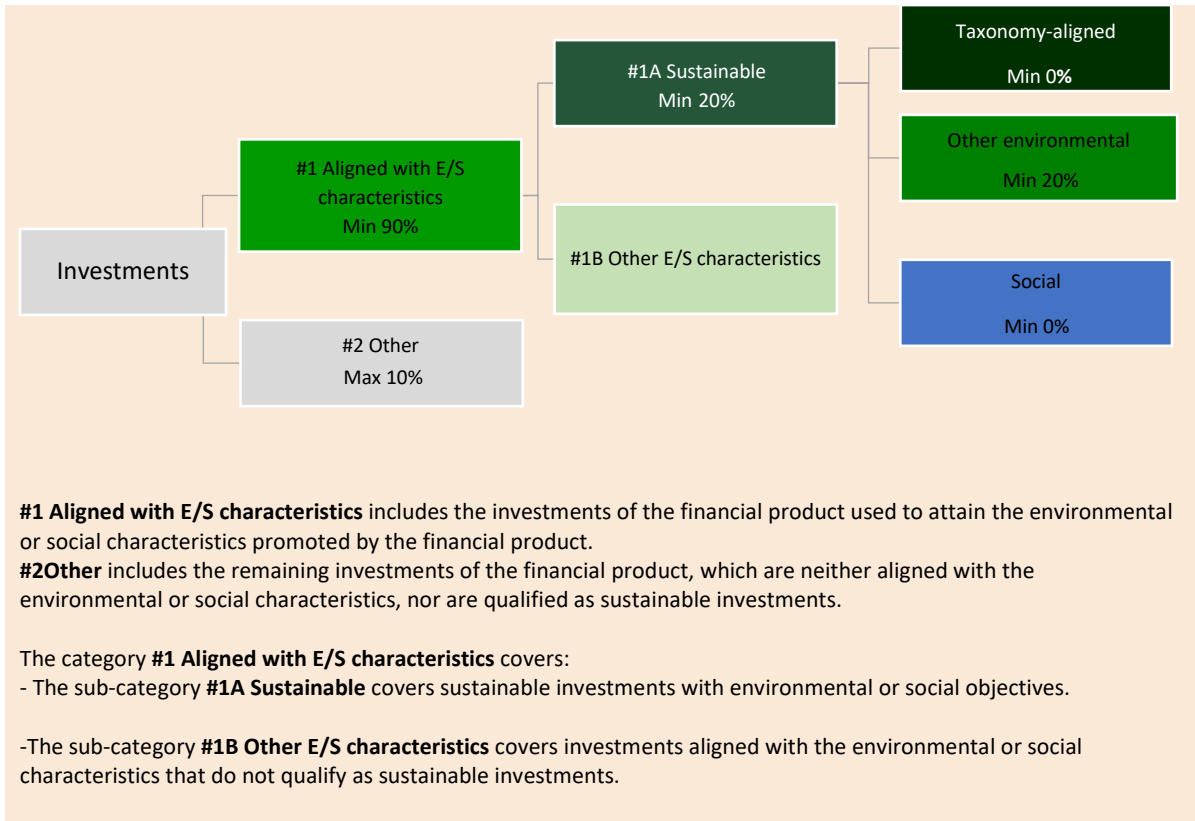
Asset allocation describes the share

of investments in specific assets.

other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A). The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 20% and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.

 **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

There is currently no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy.

There is no commitment to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, investments may be done in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

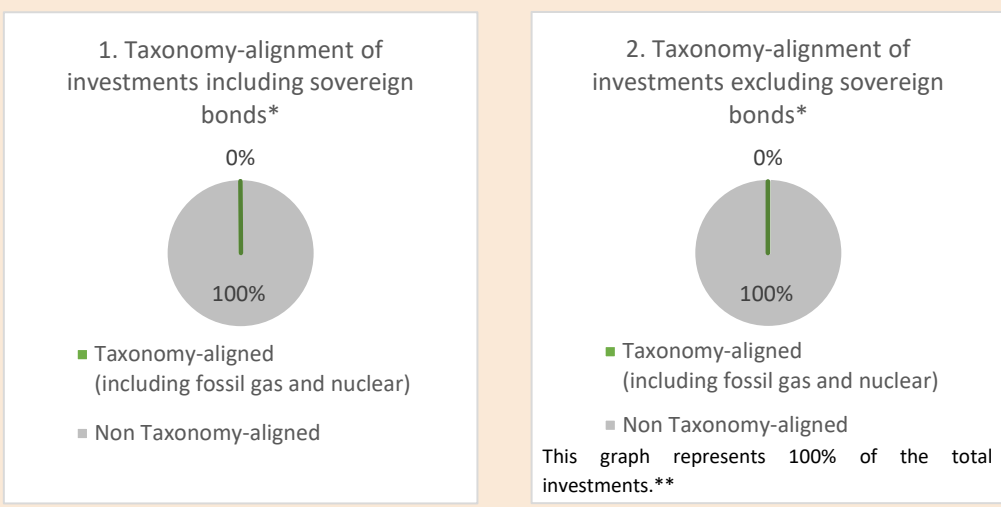
● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy² ?**

- Yes:
 In fossil gas In nuclear energy
- No

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
 **This percentage is purely indicative and may vary.


● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

There is no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change ("climate change mitigation") and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally sustainable economic activities under the EU Taxonomy.

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 20 % of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.

What is the minimum share of socially sustainable investments?



The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.

There are no minimum environmental or social safeguards.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

- ***How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?***

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

- ***How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?***

The investment objective of the financial product is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the financial product and the return of the Index.

- ***How does the designated index differ from a relevant broad market index?***

The Index aims to represent the performance of companies that are expected to derive significant revenues from energy storage technologies, autonomous vehicles, shared mobility and new transportation methods and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance (“ESG”) laggards relative to the theme universe.

- ***Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?***

Additional information on the Index can be found at : <https://www.msci.com/>



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at <https://www.amundiETF.com>.

Template pre-contractual disclosure for the financial products referred to in Article 8, paragraphs 1, 2 and 2a, of Regulation (EU) 2019/2088 and Article 6, first paragraph, of Regulation (EU) 2020/852

Product name:
Amundi MSCI Millennials ESG Screened

Legal entity identifier:

Environmental and/or social characteristics

Does this financial product have a sustainable investment objective?



Yes



No

X



It will make a minimum of sustainable investments with an environmental objective: _____%

_____%



in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



It will make a minimum of sustainable investments with a social objective: _____%



It promotes Environmental/Social (E/S) characteristics and while it does not have as its objective a sustainable investment, it will have a minimum proportion of 15 % of sustainable investments



with an environmental objective in economic activities that qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with an environmental objective in economic activities that do not qualify as environmentally sustainable under the EU Taxonomy



with a social objective



It promotes E/S characteristics, but will not make any sustainable investments



What environmental and/or social characteristics are promoted by this financial product?

The Sub-Fund promotes environmental and/or social characteristics through among others, replicating the Index, integrating an environmental, social and governance (“ESG”) rating.

The Index methodology is constructed using a “Best-in-class approach”: best ranked companies are selected to construct the Index. “Best-in-class” is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. Using such Best-in-class approach, the Index follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

- **What sustainability indicators are used to measure the attainment of each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

Sustainable investment means an investment in an economic activity that contributes to an environmental or social objective, provided that the investment does not significantly harm any environmental or social objective and that the investee companies follow good governance practices.

The **EU Taxonomy** is a classification system laid down in Regulation (EU) 2020/852, establishing a list of **environmentally sustainable economic activities**. That Regulation does not lay down a list of socially sustainable economic activities. Sustainable investments with an environmental objective might be aligned with the Taxonomy or not.

Sustainability indicators measure how the environmental or

social characteristics promoted by the financial product are attained.

The MSCI ESG Rating is used to measure the attainment of each of the environmental and or social characteristic promoted by this financial product.

MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company's resilience to long-term, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company's core business and the industry-specific issues that may create significant risks and opportunities for the company. The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics.

More detailed on MSCI ESG Rating can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/34424357/MSCI+ESG+Ratings+Methodology+%28002%29.pdf>

More details on MSCI ESG Controversy score can be found on the following link:

<https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-+July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4>.

More precisely, the Index objective is to measure the performance of companies that are expected to derive significant revenues from industries that target the preferences of the "millennial" generation and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance ("ESG") laggards relative to the theme universe. It selects companies which are assessed to have high exposure to business activities such as:

- Popular Brands,
- Health and Fitness,
- Travel and Leisure,
- Social Media and Entertainment,
- Housing and home goods,
- Financial services,
- Food and Dining,
- Clothing and Apparel.

The Index features the following characteristics:

- a) Same investment universe as the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "**Parent Index**"); i.e., including large, mid and small cap stocks across developed and emerging countries.
- b) A set of relevant words and phrases derived from the above business activities is used to identify companies (the "**Eligible Universe**") whose products and services cater to the "millennial" generation
- c) Companies from the Eligible Universe with a "Relevance Score" (as defined by MSCI) above 25% constitute the "**Selected Universe**".
- d) Further liquidity/size/country/sectorial filters are applied to the Selected Universe.
- e) An ESG negative screening is performed on the Selected Universe as defined in the methodology in order to exclude:
 - Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of UN Global Compact; and
 - Companies with no "ESG Rating" (as defined by MSCI).

f) A Filtered Universe is constructed using a “Best-in-class” approach (the “**Filtered Universe**”): bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the filtered Selected Universe. “Best-in-class” approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company’s resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company’s core business and the industry-specific issues that may create significant risks and 430 opportunities for the company.

The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics. Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Principal risks” of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Parent Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

g) The top half in terms of Relevance Score of the Filtered Universe constitutes the Index composition

h) The Index is weighted in proportion of an aggregate score combining the normalized value of three fundamental criteria: the percentage of sales spent on R&D and capex, return on invested capital and one year sales growth.

i) An iterative downweighting ensure that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the MSCI ACWI IMI Millennials Index.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundiETF.com/>.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

● ***What are the objectives of the sustainable investments that the financial product partially intends to make and how does the sustainable investment contribute to such objectives?***

The objectives of the sustainable investments are to invest in investee companies that seek to meet two criteria:

1. follow best environmental and social practices; and
2. avoid making products or providing services that harm the environment and society.

In order for the investee company to be deemed to contribute to the above objective it must be a “best performer” within its sector of activity on at least one of its material environmental or social factors.

The definition of “best performer” relies on Amundi’s proprietary ESG methodology which aims to measure the ESG performance of an investee company. In order to be considered a “best performer”, an investee company must perform with the best top three rating (A, B or C, out of a rating scale going from A to G) within its sector on at least one material environmental or social factor. Material environmental and social factors are identified at a sector level. The identification of material factors is based on Amundi ESG analysis framework which combines extra-financial data and qualitative analysis of associated sector and sustainability themes. Factors identified as material result in a contribution of

more than 10% to the overall ESG score. For energy sector for example, material factors are: emissions and energy, biodiversity and pollution, health and security, local communities and human rights. For a more complete overview of sectors and factors, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu

To contribute to the above objectives, the investee company should not have significant exposure to activities (e.g. tobacco, weapons, gambling, coal, aviation, meat production, fertilizer and pesticide manufacturing, single-use plastic production) not compatible with such criteria.

The sustainable nature of an investment is assessed at investee company level.

By applying the Amundi's above described Sustainable Investment definition to the Index constituents of this passively managed ETF Product, Amundi has determined that this Product has the minimum proportion of sustainable investments stated in page 1 above. However, please note that Amundi Sustainable Investment definition is not implemented at the Index methodology level.

Principal adverse impacts are the most significant negative impacts of investment decisions on sustainability factors relating to environmental, social and employee matters, respect for human rights, anti-corruption and anti-bribery matters.

● ***How do the sustainable investments that the financial product partially intends to make, not cause significant harm to any environmental or social sustainable investment objective?***

To ensure sustainable investments do no significant harm ('DNSH'), Amundi utilises two filters:

- The first DNSH filter relies on monitoring the mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available (e.g. GHG intensity of investee companies) via a combination of indicators (e.g. carbon intensity) and specific thresholds or rules (e.g. that the investee company's carbon intensity does not belong to the last decile of the sector). Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.
- Beyond the specific sustainability factors covered in the first filter, Amundi has defined a second filter, which does not take the mandatory Principal Adverse Impact indicators above into account, in order to verify that the company does not badly perform from an overall environmental or social standpoint compared to other companies within its sector which corresponds to an environmental or social score superior or equal to E using Amundi's ESG rating.

– ***How have the indicators for adverse impacts on sustainability factors been taken into account?***

The indicators for adverse impacts have been taken into account as detailed in the first do not significant harm (DNSH) filter above:

The first DNSH relies on monitoring of mandatory Principal Adverse Impacts indicators in Annex 1, Table 1 of the RTS where robust data is available via the combination of following indicators and specific thresholds or rules:

- Have a CO₂ intensity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector (only applies to high intensity sectors),
- Have a Board of Directors' diversity which does not belong to the last decile compared to other companies within its sector,
- Be cleared of any controversy in relation to work conditions and human rights, and
- Be cleared of any controversy in relation to biodiversity and pollution.

Amundi already considers specific Principle Adverse Impacts within its exclusion policy as part of Amundi's Responsible Investment Policy. These exclusions, which apply on the top of the

tests detailed above, cover the following topics: exclusions on controversial weapons, Violations of UN Global Compact principles, coal and tobacco.

– *How are the sustainable investments aligned with the OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights? Details:*

The OECD Guidelines for Multinational Enterprises and the UN Guiding Principles on Business and Human Rights are integrated into our ESG scoring methodology. Our proprietary ESG rating tool assesses issuers using available data from our data providers. For example, the model has a dedicated criteria called “Community Involvement & Human Rights” which is applied to all sectors in addition to other human rights linked criteria including socially responsible supply chains, working conditions, and labor relations. Furthermore, we conduct controversy monitoring on a, at minimum, quarterly basis which includes companies identified for human rights violations. When controversies arise, analysts will evaluate the situation and apply a score to the controversy (using our proprietary scoring methodology) and determine the best course of action. Controversy scores are updated quarterly to track the trend and remediation efforts.

The EU Taxonomy sets out a “do not significant harm” principle by which Taxonomy-aligned investments should not significantly harm EU Taxonomy objectives and is accompanied by specific EU criteria.

The “do no significant harm” principle applies only to those investments underlying the financial product that take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities. The investments underlying the remaining portion of this financial product do not take into account the EU criteria for environmentally sustainable economic activities.

Any other sustainable investments must also not significantly harm any environmental or social objectives.



Does this financial product consider principal adverse impacts on sustainability factors?

Yes, the financial product considers all the mandatory Principal Adverse Impacts as per Annex 1, Table 1 of the RTS applying to the financial product’s strategy and relies on a combination of exclusion policies (normative and sectorial), ESG rating integration into the investment process, engagement and voting approaches:

- **Exclusion:** Amundi has defined normative, activity-based and sector-based exclusion rules covering some of the key adverse sustainability indicators listed by the Disclosure Regulation.
- **ESG factors integration:** Amundi has adopted minimum ESG integration standards applied by default to its actively managed open-ended funds (exclusion of G rated issuers and better weighted average ESG score higher than the applicable benchmark). The 38 criteria used in Amundi ESG rating approach were also designed to consider key impacts on sustainability factors, as well as quality of the mitigation undertaken are also considered in that respect.
- **Engagement:** Engagement is a continuous and purpose driven process aimed at influencing the activities or behaviour of investee companies. The aim of engagement activities can fall into two categories: to engage an issuer to improve the way it integrates the environmental and social dimension, to engage an issuer to improve its impact on environmental, social, and human

rights-related or other sustainability matters that are material to society and the global economy.

- **Vote:** Amundi's voting policy responds to a holistic analysis of all the long-term issues that may influence value creation, including material ESG issues. For more information, please refer to Amundi's Voting Policy¹.
- **Controversies monitoring:** Amundi has developed a controversy tracking system that relies on three external data providers to systematically track controversies and their level of severity. This quantitative approach is then enriched with an in-depth assessment of each severe controversy, led by ESG analysts and the periodic review of its evolution. This approach applies to all of Amundi's funds.

For any indication on how mandatory Principal Adverse Impact indicators are used, please refer to the Amundi ESG Regulatory Statement available at www.amundi.lu.

No



What investment strategy does this financial product follow?

The Sub-Fund objective is to track the performance of MSCI ACWI IMI Millennials ESG Filtered Index (the "**Index**"), and to minimize the tracking error between the net asset value of the sub-fund and the performance of the Index.

The Index objective is to measure the performance of companies that are expected to derive significant revenues from industries that target the preferences of the "millennial" generation and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance ("**ESG**") laggards relative to the theme universe.

The investment strategy guides investment decisions based on factors such as investment objectives and risk tolerance.

- **What are the binding elements of the investment strategy used to select the investments to attain each of the environmental or social characteristics promoted by this financial product?**

This is a passively managed ETF. Its investment strategy is to replicate the Index while minimizing the related tracking error.

The Index objective is to measure the performance of companies that are expected to derive significant revenues from industries that target the preferences of the "millennial" generation and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance ("**ESG**") laggards relative to the theme universe. The Index is constructed by selecting stocks from the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the "**Parent Index**"). It selects companies which are assessed to have high exposure to business activities such as:

- Popular Brands,
- Health and Fitness,
- Travel and Leisure,
- Social Media and Entertainment,

¹ <https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646>

- Housing and home goods,
- Financial services,
- Food and Dining,
- Clothing and Apparel.

The Index is an equity index calculated and published by the international index provider MSCI. The Index features the following characteristics:

a) Same investment universe as the MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (the “**Parent Index**”); i.e., including large, mid and small cap stocks across developed and emerging countries.

b) A set of relevant words and phrases derived from the above business activities is used to identify companies (the “**Eligible Universe**”) whose products and services cater to the “millennial” generation

c) Companies from the Eligible Universe with a “Relevance Score” (as defined by MSCI) above 25% constitute the “**Selected Universe**”.

d) Further liquidity/size/country/sectorial filters are applied to the Selected Universe.

e) An ESG negative screening is performed on the Selected Universe as defined in the methodology in order to exclude:

- Companies with exposure to controversial businesses such as controversial weapons, conventional weapons, tobacco, thermal coal, civilian firearms, oil sands, nuclear weapons or companies in violation of UN Global Compact; and
- Companies with no “ESG Rating” (as defined by MSCI).

f) A Filtered Universe is constructed using a “Best-in-class” approach (the “**Filtered Universe**”): bottom quartile companies by an industry-adjusted ESG Rating (as defined by MSCI) are excluded from the filtered Selected Universe. “Best-in-class” approach is an approach where leading or best-performing investments are selected within a universe, industry sector or class. MSCI ESG Rating methodology uses a rules-based methodology designed to measure a company’s resilience to longterm, industry material ESG risks. It is based on extra-financial ESG key issues that focus on the intersection between a company’s core business and the industry-specific issues that may create significant risks and 430 opportunities for the company.

The ESG key issues are weighted according to impact and time horizon of the risk or opportunity. The ESG key issues include for instance, but are not limited to, water stress, carbon emissions, labor management or business ethics. Using such Best-in-class approach, the Sub-Fund follows an extra-financial approach significantly engaging that permits the reduction by at least 20% of the initial investment universe (expressed in number of issuers).

Limits of the extra-financial approach are mentioned in the section “Principal risks” of the prospectus. The extra-financial data coverage is 100% of the eligible securities of the Parent Index. Non ESG rated companies are excluded from the selection process of the Index.

g) The top half in terms of Relevance Score of the Filtered Universe constitutes the Index composition

h) The Index is weighted in proportion of an aggregate score combining the normalized value of three fundamental criteria: the percentage of sales spent on R&D and capex, return on invested capital and one year sales growth.

i) An iterative downweighing ensure that the carbon intensity and the weighted average of board independence of the Index are respectively lower and higher than the ones of the MSCI ACWI IMI Millennials Index.

For further information in relation to the general and specific environmental, social and governance (ESG) objectives targeted by the Sub-Fund, please refer to the Transparency Code of the Sub-Fund available on <https://www.amundi-etf.com/>.

Environmental and/or social characteristics promoted by the Sub-Fund are met through the MSCI ESG Rating methodology (as described above).

The Product strategy is also relying on systematic exclusions policies (normative and sectorials) as further described in Amundi Responsible Investment policy.

Good governance

practices include sound management structures, employee relations, remuneration of staff and tax compliance.

- ***What is the committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy?***

There is no committed minimum rate to reduce the scope of the investments considered prior to the application of that investment strategy.

- ***What is the policy to assess good governance practices of the investee companies?***

We rely on Amundi ESG scoring methodology. Amundi's ESG scoring is based on a proprietary ESG analysis framework, which accounts for 38 general and sector-specific criteria, including governance criteria. In the Governance dimension, we assess an issuer's ability to ensure an effective corporate governance framework that guarantees it will meet its long-term objectives (e.g. guaranteeing the issuer's value over the long term) The governance sub-criteria considered are: board structure, audit and control, remuneration, shareholders' rights, ethics, tax practices and ESG strategy.

Amundi ESG Rating scale contains seven grades, ranging from A to G, where A is the best and G the worst rating. G-rated companies are excluded from our investment universe.

Each corporate security (shares, bonds, single name derivatives, ESG equity and fixed income ETFs) included in investment portfolios has been assessed for good governance practices applying a normative screen against UN Global Compact (UN GC) principles on the associated issuer. The assessment is performed on an ongoing basis. Amundi's ESG ratings Committee monthly reviews lists of companies in breach of the UN GC leading to rating downgrades to G. Divestment from securities downgraded to G is carried out by default within 90 days.

Amundi Stewardship Policy (engagement and voting) related to governance complements this approach.



What is the asset allocation planned for this financial product?

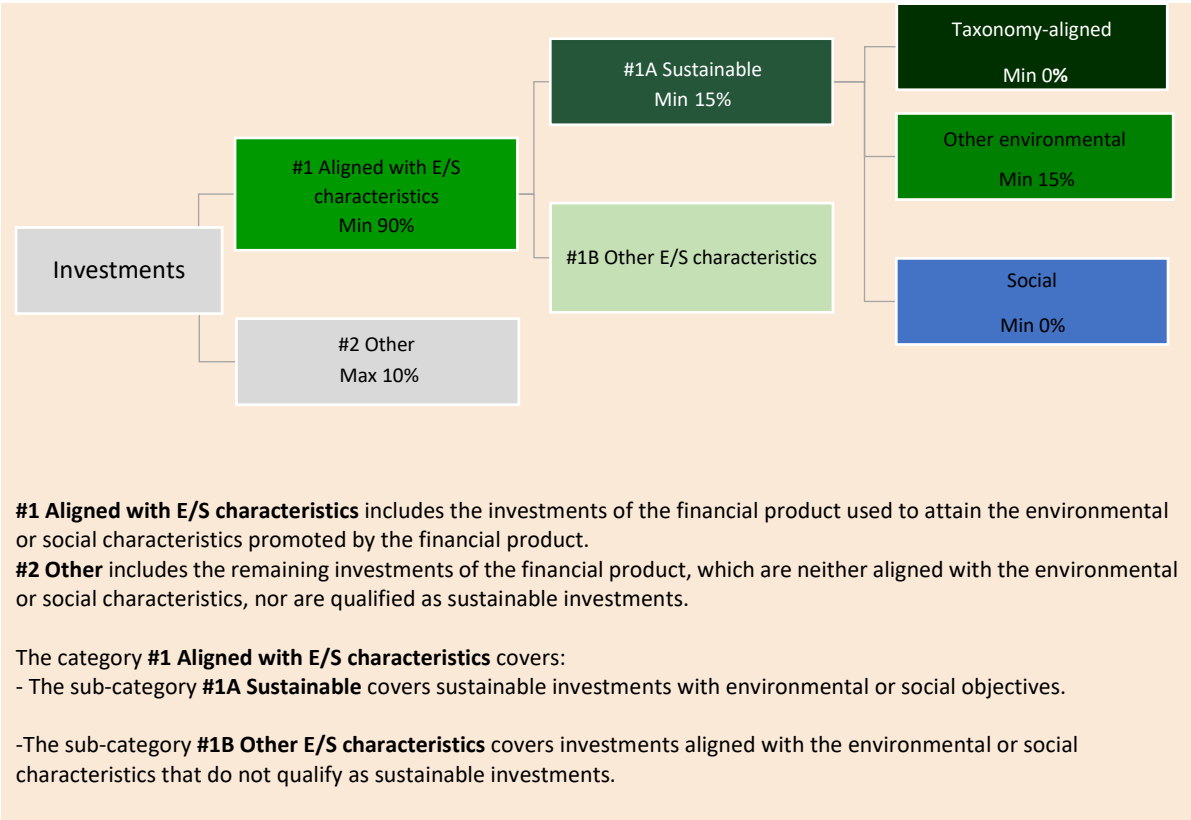
At least 90% of the Sub-Fund's securities and instruments will meet the promoted environmental or social characteristics in accordance with the binding elements of the Index methodology. Furthermore, the Sub-Fund commits to have a minimum of 15 % of sustainable investments as per the below chart. Investments aligned with other E/S characteristics (#1B) will represent the difference between the actual proportion of investments aligned with environmental or social characteristics (#1) and the actual proportion of sustainable investments (#1A). The planned proportion of other environmental investment represents a minimum of 15 % and may change as the actual proportions of Taxonomy-aligned and/or Social investments increase.

Asset allocation

describes the share of investments in specific assets.

Taxonomy-aligned activities are expressed as a share of:

- turnover reflecting the share of revenue from green activities of investee companies
- capital expenditure (CapEx) showing the green investments made by investee companies, e.g. for a transition to a green economy.
- operational expenditure (OpEx) reflecting green operational activities of investee companies.



● **How does the use of derivatives attain the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

Derivatives are not used to attain the environmental and social characteristics promoted by the Sub-Fund.

 **To what minimum extent are sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy?**

The Sub-Fund currently has no minimum commitment to sustainable investments with an environmental objective aligned with the EU Taxonomy.

The Sub-Fund does not commit to make taxonomy-compliant investments in fossil gas and/or nuclear energy as illustrated below. Nevertheless, as part of the investment strategy, investments may be done in companies that are also active in these industries. Such investments may or may not be taxonomy aligned.

● **Does the financial product invest in fossil gas and/or nuclear energy related activities that comply with the EU Taxonomy² ?**

Yes:

In fossil gas In nuclear energy

X

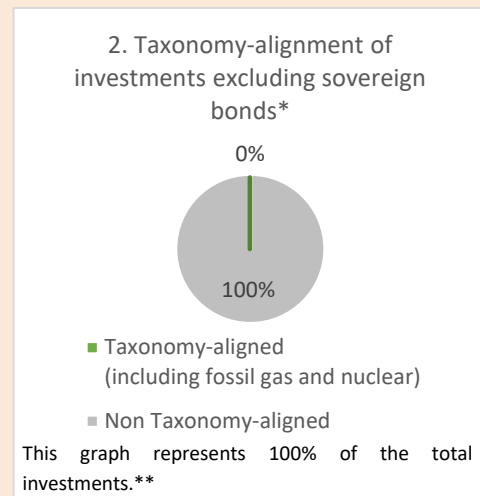
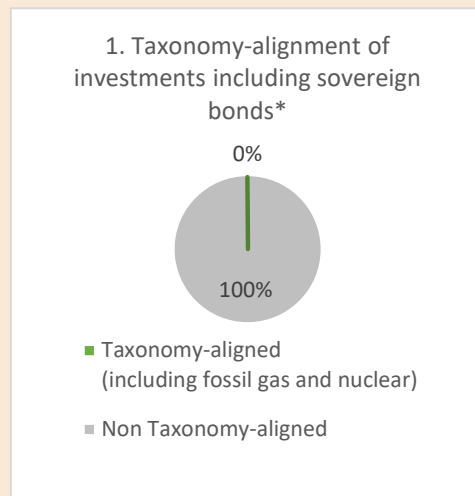
² Fossil gas and/or nuclear related activities will only comply with the EU Taxonomy where they contribute to limiting climate change (“climate change mitigation”) and do not significantly harm any EU Taxonomy objective. The full criteria for fossil gas and nuclear energy economic activities that comply with the EU Taxonomy are laid down in Commission Delegated Regulation (EU) 2022/1214.

No

Enabling activities directly enable other activities to make a substantial contribution to an environmental objective.

Transitional activities are activities for which low-carbon alternatives are not yet available and among others have greenhouse gas emission levels corresponding to the best performance.

The two graphs below show in green the minimum percentage of investments that are aligned with the EU Taxonomy. As there is no appropriate methodology to determine the Taxonomy-alignment of sovereign bonds*, the first graph shows the Taxonomy alignment in relation to all the investments of the financial product including sovereign bonds, while the second graph shows the Taxonomy alignment only in relation to the investments of the financial product other than sovereign bonds.



* For the purpose of these graphs, 'sovereign bonds' consist of all sovereign exposures
**This percentage is purely indicative and may vary.

● **What is the minimum share of investments in transitional and enabling activities?**

The Sub-Fund has no minimum proportion of investment in transitional or enabling activities.

 are sustainable investments with an environmental objective that **do not take into account the criteria** for environmentally



What is the minimum share of sustainable investments with an environmental objective that are not aligned with the EU Taxonomy?

The Sub-Fund will have a minimum commitment of 15 % of Sustainable Investments with an environmental objective as indicated in this Annex with no commitment on their alignment with the EU Taxonomy.



What is the minimum share of socially sustainable investments?

The Sub-Fund has no minimum share of socially sustainable investments.



What investments are included under “#2 Other, what is their purpose and are there any minimum environmental or social safeguards?”

Included in “#2 Other” are cash and instruments for the purpose of liquidity and portfolio risk management. It may also include ESG unrated securities for which data needed for the measurement of attainment of environmental or social characteristics is not available.

There are no minimum environmental or social safeguards.



Is a specific index designated as a reference benchmark to determine whether this financial product is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes?

Yes, the MSCI ACWI IMI Millennials ESG Filtered Index has been designated as a reference benchmark to determine whether the Sub-Fund is aligned with the environmental and/or social characteristics that it promotes.

Reference benchmarks are indexes to measure whether the financial product attains the environmental or social characteristics that they promote.

● **How is the reference benchmark continuously aligned with each of the environmental or social characteristics promoted by the financial product?**

According to applicable regulations to index sponsors (including BMR), index sponsors should define appropriate controls/diligence when defining and/or operating index methodologies of regulated indexes.

● **How is the alignment of the investment strategy with the methodology of the index ensured on a continuous basis?**

The investment objective of the Sub-Fund is to track both the upward and downward evolution of the Index, while minimising the difference between the return of the Sub-Fund and the return of the Index.

● **How does the designated index differ from a relevant broad market index?**

The Index objective is to measure the performance of companies that are expected to derive significant revenues from industries that target the preferences of the “millennial” generation and to exclude companies which are Environmental, Social and Governance (“ESG”) laggards relative to the theme universe as further described in this Annex 1 - ESG Related Disclosures to the Sub-Fund’s Prospectus.

● **Where can the methodology used for the calculation of the designated index be found?**

Additional information on the Index can be found at :www.MSCI.com



Where can I find more product specific information online?

More product-specific information can be found on the website: Additional information on the Sub-Fund can be found at <https://www.amundiETF.com>.