AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB - UCITS ETF DR - GBP

REPORTING

Communication Publicitaire

29/02/2024

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **10,51 (GBP)**
Date de VL et d'actif géré : **29/02/2024**
Actif géré : **110,86 (millions GBP)**
Code ISIN : **LU1437025296**
Type de Réplication : **Physique**
Indice de référence :
100% MSCI UK IMI SRI FILTERED PAB

Objectif d'investissement

AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB - UCITS ETF DR a pour objectif de répliquer au plus près la performance de l'indice MSCI UK IMI SRI Filtered PAB (dividendes nets réinvestis), à la hausse comme à la baisse. Cet ETF offre une exposition aux sociétés à grande, moyenne et petite capitalisation du marché britannique en utilisant une approche "best-in-class" qui sélectionne les sociétés qui ont les meilleures notations MSCI ESG. Les sociétés impliquées dans l'énergie nucléaire, les armes nucléaires, le tabac, l'alcool, le jeu, les armes controversées, les armes conventionnelles, les armes à feu civiles, le pétrole et le gaz, le charbon thermique, les organismes génétiquement modifiés, le divertissement pour adultes, ou encore les acteurs exploitant des réserves d'énergies fossiles sont exclues de l'indice et la pondération de chaque composant est plafonnée à 5 %. En outre, en matière de transition climatique, l'ETF répond aux exigences minimales du règlement de l'UE (EU PAB).
Pour de plus amples informations, veuillez-vous référer au KIID et au prospectus du fonds ainsi qu'à la Méthodologie des indices MSCI pour une description complète des critères d'exclusion.

Indicateur de risque *(Source : Fund Admin)*

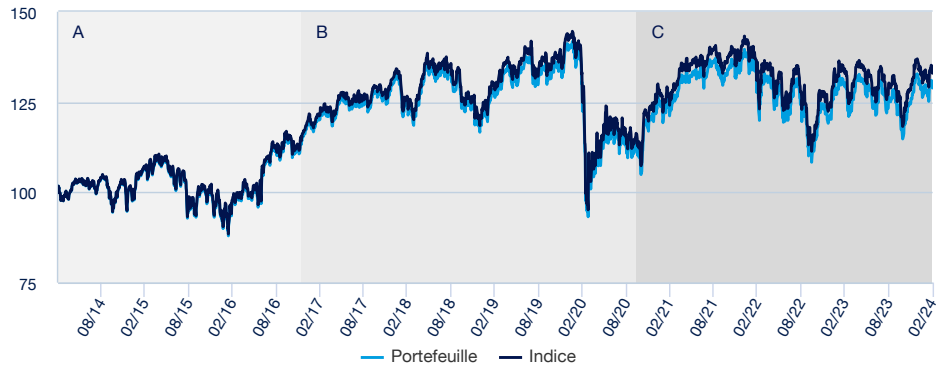
1	2	3	**4**	5	6	7

Risque le plus faible — Risque le plus élevé

⚠ L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 5 ans.
L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

Performances (Source : Fund Admin) - *Les performances passées ne préjugent pas des performances futures*

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



A : Simulation faite sur la base des performances, du 22 septembre 2009 au 12 décembre 2016, du Fonds français « AMUNDI ETF FTSE 100 UCITS ETF » géré par Amundi Asset Management, et absorbé par AMUNDI ETF FTSE 100 le 13 décembre 2016.
B : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment a été l'indice FTSE 100.
C : Depuis le début de cette période, l'indicateur de référence du compartiment est MSCI UK IMI SRI Filtered PAB

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	15,23%	14,61%	15,60%
Volatilité de l'indice	15,27%	14,64%	15,61%
Tracking Error ex-post	0,12%	0,14%	0,07%
Ratio de sharpe	-0,26	0,02	0,29

* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an.
L'indicateur Tracking Error mesure l'écart de rendement entre le fonds et l'indice

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le 29/12/2023	1 mois 31/01/2024	3 mois 30/11/2023	1 an 28/02/2023	3 ans 26/02/2021	5 ans 28/02/2019	Depuis le 02/07/2010
Portefeuille	-1,92%	0,23%	4,00%	0,38%	7,05%	2,74%	102,59%
Indice	-1,87%	0,26%	4,10%	0,68%	7,83%	4,28%	110,92%
Ecart	-0,05%	-0,02%	-0,10%	-0,30%	-0,78%	-1,54%	-8,33%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	10,01%	-12,72%	13,13%	-12,60%	16,90%	-8,28%	10,63%	18,67%	-1,63%	0,44%
Indice	10,38%	-12,58%	13,38%	-12,23%	17,32%	-7,96%	11,00%	19,07%	-1,32%	0,74%
Ecart	-0,37%	-0,13%	-0,25%	-0,37%	-0,42%	-0,32%	-0,37%	-0,41%	-0,30%	-0,30%

AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB - UCITS ETF DR - GBP

ACTION

REPORTING

Communication Publicitaire
29/02/2024

** Source : Amundi. Les performances ci-dessus couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile.* ***Les performances passées ne préjugent en rien des résultats actuels et futurs et ne sont pas garantes des rendements à venir****. Les gains ou pertes éventuels ne prennent pas en compte les frais, commissions et redevances éventuels supportés par l'investisseur lors de l'émission et du rachat des parts (ex : taxes, frais de courtage ou autres commissions prélevés par l'intermédiaire financier…). Si les performances sont calculées dans une devise autre que l'euro, les gains ou les pertes éventuellement générés peuvent de ce fait être impactées par les fluctuations des taux de change (à la hausse comme à la baisse). L'écart correspond à la différence de performance du portefeuille et de l'indice.*

Rencontrez l'équipe



Isabelle Lafargue

Responsable Gestion Indicielle & Multistratégies – Fonds Régionaux



Quentin Berrou

Gérant de portefeuille principal

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice MSCI UK IMI SRI Filtered PAB est un indice d'actions basé sur l'Indice MSCI United Kingdom IMI représentatif des titres de moyenne à grande capitalisation du marché britannique (l'« Indice parent »). L'Indice offre une exposition aux sociétés assorties de la meilleure notation en matière environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) dans chaque secteur de l'Indice parent et exclut les sociétés dont les produits ont un impact social ou environnemental négatif. En outre, l'Indice vise à représenter la performance d'une stratégie qui pondère à nouveau les titres en fonction des opportunités et des risques liés à la transition climatique afin de répondre aux exigences minimales des réglementations de l'Union européenne relatives à l'Accord de Paris (EU PAB).

Caractéristiques (Source : Amundi)

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

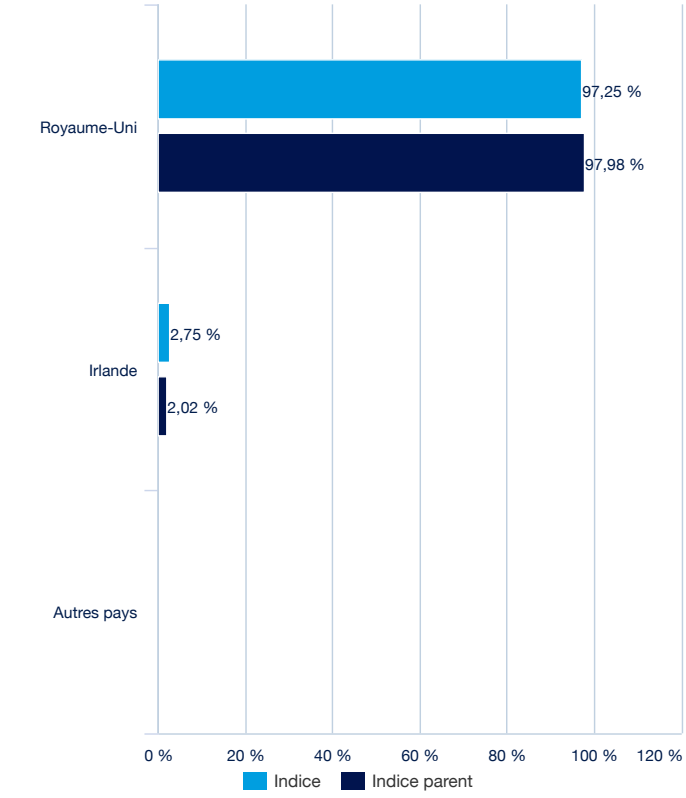
Nombre de valeurs : **98**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

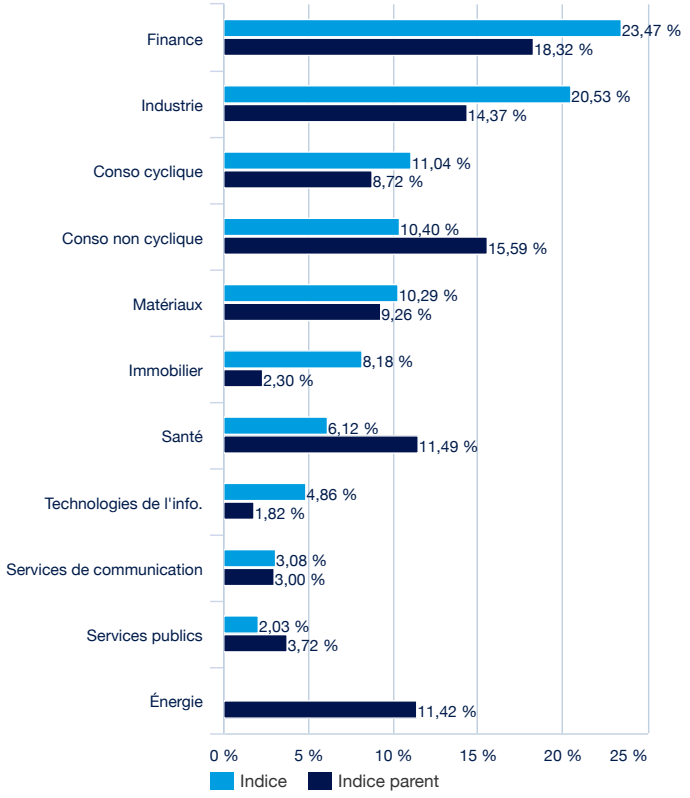
	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
RELX PLC	5,68%	2,99%
ASTRAZENECA GBP	4,96%	7,27%
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,85%	1,71%
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	4,57%	1,67%
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,95%	1,36%
BARCLAYS PLC	3,21%	1,18%
HALMA PLC	3,00%	0,40%
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,87%	0,35%
3I GROUP PLC	2,77%	1,10%
CRH PLC UK	2,75%	2,02%
Total	**38,59%**	**20,05%**

Indice parent : **MSCI United Kingdom IMI**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Amundi Asset Management, Société par Actions Simplifiée au capital de 1 143 615 555 €
Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF N° GP 04000036
Siège social : 91-93, boulevard Pasteur – 75015 Paris – France 437 574 452 RCS Paris

Indice parent : **MSCI United Kingdom IMI**

Indice parent : **MSCI United Kingdom IMI**

Investissement Socialement Responsable (ISR)

L'ISR traduit les objectifs du développement durable dans les décisions d'investissements en ajoutant les critères Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG) en complément des critères financiers traditionnels.

L'ISR vise ainsi à concilier performance économique et impact social et environnemental en finançant les entreprises et les entités publiques qui contribuent au développement durable quel que soit leur secteur d'activité. En influençant la gouvernance et le comportement des acteurs, l'ISR favorise une économie responsable.

Evaluation par critère ESG (Source : Amundi)

	Indice	Indice parent
Note Globale	8,48	7,89
Environnement	7,11	6,58
Social	5,29	5,09
Gouvernance	7,42	7,00

Indice parent : **MSCI United Kingdom IMI**

Critères ESG

Les critères sont des critères extra-financiers utilisés pour évaluer les pratiques environnementales, sociales et de gouvernance des entreprises.

Les risques et opportunités environnementaux, sociaux et de gouvernance sont triés par grandes tendances (par exemple, le changement climatique, la rareté des ressources, les changements démographiques) ainsi que par la nature des opérations de l'entreprise .

Les scores sont sur une échelle de 0 à 10, 10 étant le meilleur.

«E» pour Environnement (changement climatique, ressources naturelles, pollution & déchets et opportunités environnementales)

«S» pour Social (ressource humaine, fiabilité des produits, opposition des parties prenantes et opportunités sociales)

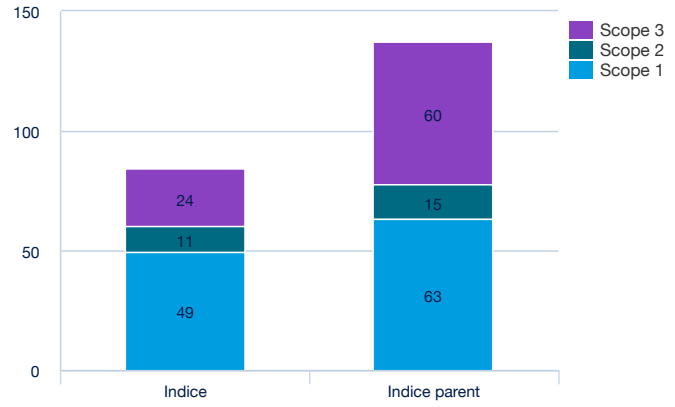
«G» pour Gouvernance (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

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

Empreinte Carbone

Emissions carbone par million d'euros investis

	Indice	Indice parent
Total en tCO2 / M€ (Indice/Indice parent) :	86,32	146,74



Indice parent : **MSCI United Kingdom IMI**

Empreinte Carbone

Cet indicateur mesure les émissions du portefeuille en tonnes de CO2 équivalent par million d'euros investis.
Il est un indicateur des émissions induites par l'investissement dans ce portefeuille.

Définition des scopes :

- Scope 1 : Ensemble des émissions directes provenant de sources détenues ou contrôlées par l'entreprise.

- Scope 2 : L'ensemble des émissions indirectes induites par l'achat ou la production d'électricité, de vapeur ou de chaleur.

- Scope 3 : L'ensemble de toutes les autres émissions indirectes, en amont et en aval de la chaine de valeur. Pour des raisons de robustesse des données, dans ce reporting nous faisons le choix de n'utiliser qu'une partie du scope 3 : les émissions amont liées aux fournisseurs de premier rang. Les fournisseurs de premier rang sont ceux avec lesquels l'entreprise a une relation privilégiée et sur lesquels elle peut directement influer.

Source : Les données sur émissions carbones sont fournies par Trucost. Elles correspondent aux émissions annuelles des entreprises et sont exprimées en tonnes équivalent CO2, i.e. elles regroupent les six gaz à effet de serre définis dans le protocole de Kyoto dont les émissions sont converties en potentiel de réchauffement global (PRG) en équivalent CO2.

Label ISR

AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB - UCITS ETF DR - GBP

REPORTING

Communication Publicitaire
29/02/2024

ACTION ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Dépositaire	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	29/06/2016
Date de la première VL	02/07/2010
Devise de référence de la classe	GBP
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1437025296
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,18% (prélevés) - 08/02/2023
Clôture fiscale	Décembre

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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	GBP	FTSE	FTSE FP	IFTSE	FTSE.PA	IFTSEINAV.PA
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	FT1K	FT1K LN	-	FT1K.L	-

Contact

Contact ETF vente

France & Luxembourg	+33 (0)1 76 32 65 76
Allemagne & Autriche	+49 (0) 800 111 1928
Italie	+39 02 0065 2965
Suisse (Allemand)	+41 44 588 99 36
Suisse (Français)	+41 22 316 01 51
UNITED KINGDOM (Retail)	+44 (0) 20 7 074 9598
UNITED KINGDOM (Instit)	+44 (0) 800 260 5644
Pays-Bas	+31 20 794 04 79
Pays Nordiques	+46 8 5348 2271
Hong Kong	+65 64 39 93 50
Espagne	+34 914 36 72 45

Contact ETF Capital Market

Téléphone	+33 (0)1 76 32 19 93
Bloomberg IB Chat	Capital Markets Amundi ETF
	Capital Markets Amundi HK ETF

Contact ETF Courtiers

BNP Paribas	+33 (0)1 40 14 60 01
Kepler Cheuvreux	+33 (0)1 53 65 35 25

Contact Amundi

Amundi ETF
90 bd Pasteur
CS 21564
75 730 Paris Cedex 15 - France
Hotline : +33 (0)1 76 32 47 74
info@amundietf.com

Fournisseurs d'indices

AMUNDI MSCI UK IMI SRI (LE « COMPARTIMENT ») N'EST PAS SPONSORISÉ, AVALISÉ, VENDU OU PROMU PAR MSCI INC. (« MSCI »), NI PAR L'UNE DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, L'UN DE SES FOURNISSEURS D'INFORMATIONS OU AUCUN TIERS CONCERNÉ PAR LA COMPOSITION OU LA CRÉATION D'UN INDICE MSCI (COLLECTIVEMENT, LES « PARTIES MSCI »). LES INDICES MSCI SONT LA PROPRIÉTÉ EXCLUSIVE DE MSCI ET SONT DES MARQUES DE SERVICE DE MSCI OU DE SES AFFILIÉS. LES INDICES MSCI ONT FAIT L'OBJET D'UNE LICENCE ACCORDÉE, POUR CERTAINS BESOINS, À AMUNDI. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE FAIT DE DÉCLARATION, NI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ÉMETTEUR OU AUX PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, OU À TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, CONCERNANT LA PERTINENCE D'INVESTIR DANS LES COMPARTIMENTS EN GÉNÉRAL OU DANS CE COMPARTIMENT EN PARTICULIER, OU LA CAPACITÉ DE TOUT INDICE MSCI À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DU MARCHÉ BOURSIER CORRESPONDANT. MSCI OU SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES SONT LES CONCÉDANTS DE LA LICENCE DE CERTAINES MARQUES DÉPOSÉES, MARQUES DE SERVICE ET NOMS COMMERCIAUX, AINSI QUE DES INDICES MSCI DÉTERMINÉS, COMPOSÉS ET CALCULÉS PAR MSCI, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI, DE CE COMPARTIMENT, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ.
AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST TENUE DE PRENDRE EN COMPTE LES BESOINS D'AMUNDI, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ DANS LE CADRE DE LA DÉFINITION, DE LA COMPOSITION OU DU CALCUL DES INDICES MSCI. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST RESPONSABLE DE LA DÉTERMINATION DE LA DATE DE LANCEMENT, DU PRIX OU DE LA QUANTITÉ DES ACTIONS DU COMPARTIMENT, NI DE LA DÉTERMINATION OU DU CALCUL DE LA FORMULE/DES CRITÈRES SELON LESQUELS, LE COMPARTIMENT EST REMBOURSABLE, TOUTES OPÉRATIONS AUXQUELLES AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A PRIS PART. PAR AILLEURS, AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A D'OBLIGATION OU DE RESPONSABILITÉ À L'ÉGARD DE L'ÉMETTEUR, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ RELATIVEMENT À L'ADMINISTRATION, À LA COMMERCIALISATION ET À L'OFFRE DE CE COMPARTIMENT.
BIEN QUE MSCI OBTIENNE DES INFORMATIONS À INCLURE OU À UTILISER DANS LE CALCUL DES INDICES MSCI PROVENANT DE SOURCES QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, LA PRÉCISION ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, LES RÉSULTATS DEVANT ÊTRE OBTENUS PAR L'ÉMETTEUR DU COMPARTIMENT, LES PORTEURS DE PARTS DE CE DERNIER OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, ET PROVENANT DE L'UTILISATION DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE PEUT ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION RELATIVES AUX INDICES MSCI OU À TOUTE DONNÉE Y FIGURANT. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE DONNE DE GARANTIE EXPRESSE OU IMPLICITE DE QUELQUE SORTE QUE CE SOIT, ET LES PARTIES MSCI NE DONNENT AUCUNE GARANTIE DE QUALITÉ MARCHANDE ET D'ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER EN CE QUI CONCERNE LES INDICES MSCI ET TOUTE DONNÉE Y FIGURANT. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE POURRA ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUS DOMMAGES DIRECTS, INDIRECTS, SPÉCIAUX, PUNITIFS, CONSÉCUTIFS OU AUTRES (Y COMPRIS TOUTE PERTE DE BÉNÉFICES), QUAND BIEN MÊME ELLE AURAIT ÉTÉ AVISÉE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

Avertissement

Document simplifié et non contractuel, destiné à être remis exclusivement aux porteurs de parts. Les caractéristiques principales du fonds sont mentionnées dans sa documentation juridique, disponible sur le site de l'AMF ou sur simple demande au siège social de la société de gestion. La documentation juridique vous est remise avant toute souscription à un fonds. La durée du fonds est illimitée. Investir implique des risques : les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.

Note Sustainability à la date du 29/02/2024. Morningstar Sustainability Rating à la date du 29/02/2024. Sustainalytics fournit une analyse du risque ESG au niveau des entreprises dans le calcul du score de durabilité de Morningstar.

Certaines informations © 2021 MSCI ESG Research LLC. Reproduit avec permission. Bien que les fournisseurs d'informations d'Amundi, y compris, sans s'y limiter, MSCI ESG Research LLC et ses sociétés affiliées (les «Parties ESG»), obtiennent des informations (les «Informations») auprès de sources qu'elles jugent fiables, aucune des parties ESG ne garantit ni l'originalité, l'exactitude et / ou l'exhaustivité des données contenues dans le présent document et déclinent expressément toutes les garanties expresses ou implicites, y compris celles de qualité marchande et d'adéquation à un usage particulier. Les informations ne peuvent être utilisées que pour votre usage interne, ne peuvent être reproduites ou rediffusées sous quelque forme que ce soit et ne peuvent pas être utilisées comme base ou composante de tout instrument financier, produit ou indice. De plus, aucune des informations ne peut être utilisée en soi pour déterminer quels titres acheter ou vendre ou quand les acheter ou les vendre. Aucune des parties ESG ne sera tenue responsable des erreurs ou omissions en relation avec les données contenues dans le présent document, ni de toute responsabilité pour tout dommage direct, indirect, spécial, punitif, consécutif ou tout autre dommage (y compris les profits perdus), même en cas de notification de la possibilité de tels dommages.