

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de ce fonds. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce fonds et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

## SELECTION EURO CLIMAT (SEPTEMBRE 2022)

Code ISIN : (C) FR0014008NQ6

OPCVM de droit français géré par Amundi Asset Management, société de Amundi

### Objectifs et politique d'investissement

### non garanti en capital

Classification AMF ("Autorité des Marchés Financiers") : Fonds à formule

La formule du FCP SELECTION EURO CLIMAT (SEPTEMBRE 2022) est construite pour une durée de 8 ans maximum à compter du 15 décembre 2022.

Cette formule est susceptible d'être remboursée en année 2, 4, 6 ou 8, à des dates prédéfinies, en fonction de l'évolution de l'indice S&P Eurozone 50 Paris-Aligned Climate Select 3.75% Decrement ("l'Indice"), indice composé de 50 entreprises européennes de l'univers S&P Eurozone LargeCap visant à participer à la décarbonation dans la zone euro et à encourager la transition vers une économie moins émettrice de gaz à effet de serre. L'Indice est calculé à partir de données fournies par plusieurs entités : S&P Global Trucost Limited, Sustainalytics et RepRisk<sup>(6)</sup>.

L'Indice est calculé en réinvestissant les dividendes, nets des retenues à la source, versés par les actions qui le composent et en retranchant un prélèvement forfaitaire de 3.75% par an.

**En année 2, 4, 6 ou 8, si la performance<sup>(4)</sup> de l'indice S&P Eurozone 50 Paris-Aligned Climate Select 3.75% Decrement par rapport à sa Valeur Initiale<sup>(1)</sup>, est positive ou nulle, alors la formule est remboursée (les autres cas ne s'appliqueront plus) :**

La Valeur Liquidative Finale<sup>(5)</sup> est alors égale à la Valeur Liquidative de Référence<sup>(2)</sup> (hors frais d'entrée) augmentée d'un gain fixe<sup>(3)</sup> de 5% multiplié par le nombre d'années écoulées<sup>(4)</sup>.

**Sinon, si en année 8, la performance<sup>(4)</sup> de l'indice S&P Eurozone 50 Paris-Aligned Climate Select 3.75% Decrement par rapport à sa Valeur Initiale<sup>(1)</sup>, est négative :**

La Valeur Liquidative Finale<sup>(5)</sup> est alors égale à :

- o si l'Indice a baissé de plus de 40% à l'issue des 8 ans par rapport à sa Valeur Initiale<sup>(1)</sup>, la Valeur Liquidative de Référence<sup>(2)</sup> (hors frais d'entrée) diminuée de l'intégralité de la baisse de l'Indice. L'investisseur subit alors une perte en capital égale à l'intégralité de la baisse de l'Indice, qui sera alors d'au moins 40% ;
- o si l'Indice a baissé de moins de 40% à l'issue des 8 ans par rapport à sa Valeur Initiale<sup>(1)</sup>, la Valeur Liquidative de Référence<sup>(2)</sup> (hors frais d'entrée).

Le fonds est géré de manière indicielle par rapport à l'Indice par le biais d'une réplique directe en investissant environ 100% de son actif dans les actions de l'Indice aux Dates de Constatation Initiale<sup>(1)</sup> et en restant par la suite à tout moment investi dans les actions de l'Indice. Toutefois, le Fonds contracte également plusieurs instruments financiers à terme (produits dérivés) qui lui permettent d'obtenir à l'échéance un montant qui permet de réaliser l'objectif de gestion. L'actif du fonds ne sera ainsi pas investi à 100% en permanence dans les actions composant l'indice du fait de l'utilisation des dérivés. En outre, avant les Dates de Constatation Initiales, le fonds adoptera une gestion de profil monétaire et ne sera pas nécessairement investi dans les actions de l'Indice.

La Société de Gestion compensera les gaz à effet de serre (GES) émis par les sociétés détenues par le FCP. Cette compensation sera effectuée via l'annulation de crédits carbone volontaires vérifiés préalablement acquis par la Société de Gestion et adossés à des projets permettant de séquestrer ou d'éviter des émissions de CO<sub>2</sub>.

La compensation de l'empreinte carbone du FCP est considérée comme partielle dans la mesure où la Société de Gestion ne compensera pas ses propres émissions de GES ni les émissions de GES liées aux contrats financiers détenus par le FCP.

L'OPC est classé article 9 au sens du Règlement SFDR (Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (dit « Règlement Disclosure »)). »

Le fonds adopte une approche extra-financière « Autre » au sens de la position AMF 2020-03 par la réplique d'un d'indice répondant aux exigences du Règlement délégué (UE) 2020/1818 de la Commission Européenne sur la méthodologie des indices de référence alignés sur les objectifs de l'Accord de Paris. Les objectifs mesurables sont, en ligne avec ces exigences :

- Objectif N°1 : une réduction de 50% de l'empreinte carbone du portefeuille d'actions du fonds par rapport à l'univers de départ (indice S&P Eurozone Largecap)
- Objectif N°2 : une réduction de 7% par an en moyenne de l'empreinte carbone du portefeuille d'actions du fonds

L'empreinte carbone est calculée sur au minimum 90% des actions en portefeuille.

**Limitations de l'approche retenue :** L'Indice utilise certaines exclusions sectorielles préalables, néanmoins l'OPC pourrait être exposé à d'autres secteurs controversés. Le fonds intègre de manière prédominante les émissions de gaz à effet de serre dans son processus d'investissement. Les autres facteurs de durabilité sont pris en compte dans une moindre mesure.

Avantages de la formule	Inconvénients de la formule
<ul style="list-style-type: none"> <li>• Si, à une date anniversaire à 2, 4, 6 ou 8 ans, la performance de l'indice S&amp;P Eurozone 50 Paris-Aligned Climate Select 3.75% Decrement par rapport à sa Valeur Initiale<sup>(1)</sup> est positive ou nulle, l'investisseur bénéficie d'un gain fixe<sup>(3)</sup> de 5% multiplié par le nombre d'années écoulées<sup>(4)</sup>.</li> <li>• Sinon, dans le cas où la formule n'a pas été réalisée par anticipation et où la performance à 8 ans<sup>(1)</sup> de l'indice S&amp;P Eurozone 50 Paris-Aligned Climate Select 3.75% Decrement est négative, mais où celui-ci n'a pas baissé de plus de 40% par rapport à sa Valeur Initiale<sup>(1)</sup>, l'investisseur bénéficie le 13 décembre 2030 de la Valeur Liquidative de Référence<sup>(2)</sup>.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Le capital n'est pas garanti</li> <li>• L'investisseur ne connaît pas a priori l'échéance de la formule qui peut être de 2, 4, 6 ou 8 ans, selon l'évolution de l'Indice. Pour bénéficier de la formule, l'investisseur doit conserver ses parts jusqu'à la Valeur Liquidative Finale<sup>(1)</sup>.</li> <li>• Le gain fixe est limité à 5% multiplié par le nombre d'années écoulées<sup>(4)</sup>, l'investisseur peut donc ne pas profiter intégralement de la hausse de l'Indice, en raison du mécanisme de plafonnement des gains.</li> <li>• Si la formule n'a pas été réalisée par anticipation et si l'Indice a baissé de plus de 40% à 8 ans par rapport à sa Valeur Initiale<sup>(1)</sup>, la Valeur Liquidative Finale sera égale à la Valeur Liquidative de Référence<sup>(2)</sup> diminuée de l'intégralité de la baisse de l'Indice ; le porteur subit alors une perte en capital qui sera alors d'au moins 40%.</li> <li>• L'indice S&amp;P Eurozone 50 Paris-Aligned Climate Select 3.75% Decrement est calculé, dividendes nets des retenues à la source réinvestis, diminué d'un montant forfaitaire de 3,75% par an. Si les dividendes distribués, nets des retenues à la source, sont inférieurs (respectivement supérieurs) au niveau de prélèvement forfaitaire, la performance de l'Indice en sera pénalisée (respectivement améliorée) par rapport à un indice classique dividendes non réinvestis.</li> <li>• Les taux des retenues à la source appliqués aux dividendes peuvent évoluer défavorablement en cours de vie du produit.</li> </ul>

<sup>(1)</sup> définition précise au paragraphe « Description de la formule » du Prospectus du fonds.

<sup>(2)</sup> la Valeur Liquidative de Référence correspond à la plus haute valeur liquidative du fonds (hors frais d'entrée) établie entre le 1 septembre 2022 et le 15 décembre 2022 inclus.

<sup>(3)</sup> appliqué à la Valeur Liquidative de Référence.

<sup>(4)</sup> soit un rendement annuel de 4,89% à 2 ans, 4,66% à 4 ans, 4,47% à 6 ans et 4,30% à 8 ans.

<sup>(5)</sup> Le fonds étant investi en actions de l'indice, la date de Valeur Liquidative Finale pourrait être décalée en cas d'impossibilité de vendre les actions en portefeuille (perturbation du marché, suspension de la cotation d'une ou plusieurs actions ou absence de liquidité sur certaines actions). Le décalage de la Valeur Liquidative Finale sera toutefois limité à un mois et ne remettra pas en cause l'application de la formule.

Pour plus de précisions sur la formule et l'Indice, veuillez vous reporter au Prospectus du fonds.

<sup>(6)</sup> Des détails sur chacune de ces entités et leurs rôles sont fournis dans le Prospectus du fonds.

Pour plus de précisions sur la formule et l'indice S&P Eurozone 50 Paris-Aligned Climate Select 3.75% Decrement, veuillez-vous reporter au Prospectus du fonds.

SELECTION EURO CLIMAT (SEPTEMBRE 2022) est éligible au PEA et à un support d'un contrat d'assurance vie en unité de compte.

Les revenus nets du fonds sont intégralement réinvestis.

La devise de référence est l'euro (EUR)

Vous pouvez demander le remboursement de vos parts chaque jour, les opérations de rachat sont exécutées de façon quotidienne.

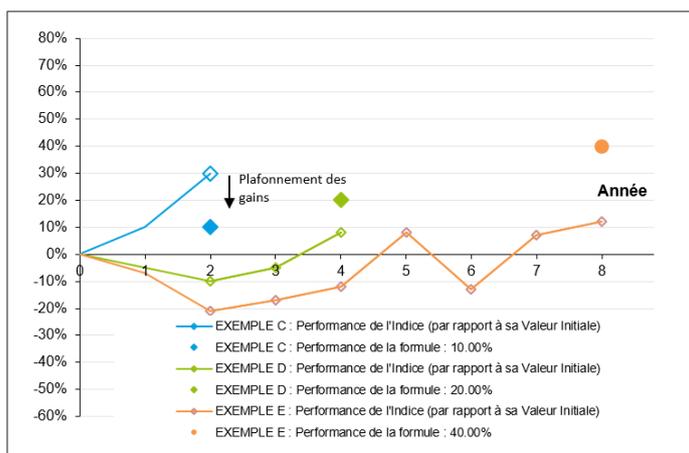
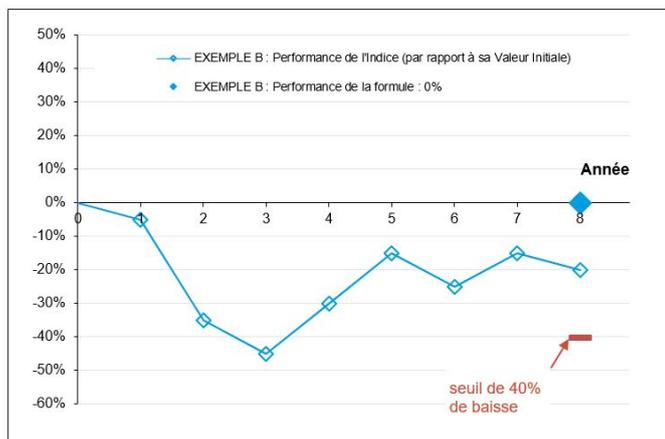
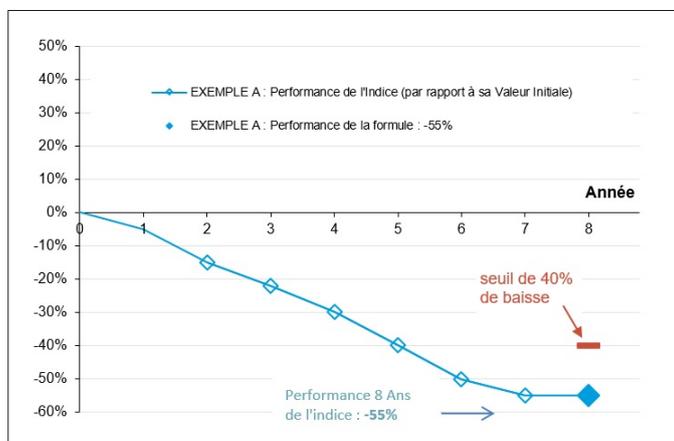
**Recommandation :** En investissant dans SELECTION EURO CLIMAT (SEPTEMBRE 2022), votre horizon de placement est de 8 ans. Ce fonds est construit dans la perspective d'un investissement pour toute la durée de vie de la formule. Il est donc fortement recommandé de n'acheter des parts de ce fonds que si vous avez l'intention de les conserver jusqu'à l'échéance de la formule (13 décembre 2024, 15 décembre 2026, 15 décembre 2028, 13 décembre 2030) selon l'évolution de l'Indice. Avant cette échéance, le prix de vente sera fonction des marchés ce jour-là. Il pourra être très différent (inférieur ou supérieur) du montant résultant de l'application de la formule annoncée.

L'OPC est soumis à un risque en matière de durabilité tel que défini dans le profil de risque. Ce fonds à formule est un fonds de gestion passive investissant dans des instruments financiers à terme (produits dérivés), qui n'applique pas la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi et n'intègre donc pas des facteurs de durabilité dans son processus d'investissement.

## ILLUSTRATIONS DE LA FORMULE

Les exemples chiffrés sont donnés à titre indicatif uniquement afin d'illustrer le mécanisme de la formule, et ne préjugent en rien des performances passées, présentes ou futures du fonds.

Les différents scénarii exposés ci-dessous ne préjugent pas de la probabilité de réalisation de l'un d'entre eux.



<sup>(5)</sup> sur la période du 15 décembre 2022 au 13 décembre 2024

<sup>(6)</sup> sur la période du 15 décembre 2022 au 15 décembre 2026

<sup>(7)</sup> sur la période du 15 décembre 2022 au 13 décembre 2030

<sup>(8)</sup> pour une Valeur Liquidative de Référence de 100 €

## Profil de risque et de rendement

à risque plus faible,

à risque plus élevé,

rendement potentiellement plus faible

rendement potentiellement plus élevé

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

L'OPCVM a un niveau de risque de 5. Le niveau de risque du fonds est caractéristique d'un fonds à formule exposé dans certains scénarios à l'intégralité du risque de baisse des actions composant l'indice.

Les données historiques utilisées pour le calcul de l'indicateur de risque numérique pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur.

La catégorie de risque associée à ce fonds n'est pas garantie et pourra évoluer dans le temps. En cas de rachat avant l'échéance, le porteur prend un risque non mesurable a priori, le prix de vente étant fonction des marchés ce jour-là. Le prix pourra être très différent (inférieur ou supérieur) du montant résultant de l'application de la formule. La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Le capital initialement investi ne bénéficie d'aucune garantie.

Les risques importants pour l'OPCVM non pris en compte dans l'indicateur sont :

- Risque de contrepartie : il représente le risque de défaillance d'un intervenant de marché l'empêchant d'honorer ses engagements vis-à-vis de votre portefeuille.
  - L'utilisation de produits complexes tels que les produits dérivés peut entraîner une amplification des mouvements de titres dans votre portefeuille.
- La survenance de l'un de ces risques peut avoir un impact négatif sur la valeur liquidative du portefeuille.

## Frais

Les frais et commissions acquittés servent à couvrir les coûts d'exploitation de l'OPCVM y compris les coûts de commercialisation et de distribution des parts, ces frais réduisent la croissance potentielle des investissements.

### Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement

<b>Frais d'entrée</b>	2,00 %
<b>Frais de sortie</b>	A l'échéance : néant Entre le 1 septembre et le 15 décembre 2022 inclus: néant 1,00 % acquis au fonds aux autres dates

Ces taux correspondent au pourcentage maximal pouvant être prélevé sur votre capital avant que celui-ci ne soit investi (entrée) ou ne vous soit remboursé (sortie).

### Frais prélevés par le fonds sur une année

<b>Frais courants</b>	1.66%**
-----------------------	---------

### Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances

Commission de performance	Néant
---------------------------	-------

Pour plus d'information sur les frais, veuillez vous référer à la rubrique « **frais et commission** » du prospectus de cet OPCVM, disponible sur simple demande auprès de la société de gestion.

Les **frais d'entrée et de sortie** affichés sont des frais maximum. Dans certains cas, les frais payés peuvent être inférieurs - vous pouvez obtenir plus d'information auprès de votre conseiller financier.

Le pourcentage des **frais courants** peut varier d'une année sur l'autre. Il exclut :

- Les commissions de surperformance
- Les frais de transaction, ou frais d'intermédiation non maîtrisés par la société de gestion, à l'exception des frais d'entrée et de sortie payés par l'OPCVM lorsqu'il achète ou vend des parts d'un autre OPC.

\*\* Le pourcentage des frais courants communiqué ici est une estimation. Pour chaque exercice, le rapport annuel de l'OPCVM donnera le montant exact des frais encourus.

## Informations pratiques

Nom du dépositaire : CACEIS Bank.

### Informations supplémentaires relatives à l'OPC :

Le dernier prospectus et les derniers documents périodiques, ainsi que toutes autres informations pratiques, sont disponibles gratuitement auprès de la société de gestion.

Les détails actualisés de la politique de rémunération de la société de gestion sont disponibles sur son site internet ou gratuitement sur simple demande écrite auprès de celle-ci.

Cette politique décrit notamment les modalités de calcul des rémunérations et avantages de certaines catégories de salariés, les organes responsables de leur attribution ainsi que la composition du Comité de rémunération.

La valeur liquidative est disponible sur simple demande auprès de la société de gestion et sur le site [www.ca-sicavetfcp.fr](http://www.ca-sicavetfcp.fr).

### Fiscalité :

Selon votre régime fiscal, les plus-values et revenus éventuels liés à la détention de titres du FCP peuvent être soumis à taxation. Nous vous conseillons de vous renseigner à ce sujet auprès du commercialisateur de votre conseiller habituel.

### Responsabilité :

La responsabilité de Amundi Asset Management ne peut être engagée que sur la base de déclarations contenues dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du prospectus.

Le FCP n'est pas ouvert aux résidents des Etats Unis d'Amérique/"U.S. Person" (la définition de "U.S. Person" est disponible sur le site internet de la société de gestion [www.amundi.com](http://www.amundi.com) et/ou dans le prospectus.

Cet OPCVM est agréé en France et réglementé par l'Autorité des marchés financiers (AMF).

La société de gestion Amundi Asset Management est agréée en France et réglementée par l'Autorité des marchés financiers (AMF).

Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 17 août 2022.