SELECTION EURO ENVIRONNEMENT (JANVIER 2022)

REPORTING

Communication Publicitaire

29/02/2024

STRUCTURÉ ■

Article 8 ■

Données clés (Source : Amundi)

Forme juridique : **Fonds Commun de Placement (FCP)**
Classification AMF : **Fonds à formule**
Droit applicable : **de droit français**
Code ISIN : **FR0014006FX2**
Affectation des sommes distribuables : **Capitalisation**
Garant : **AMUNDI FINANCE**
Devise de référence de la classe : **EUR**
Actif géré : **120,96 (millions EUR)**
Unité de la première souscription : **0 Part(s)**
Périodicité de calcul de la VL : **Quotidienne**
Société de gestion : **Amundi Asset Management**
Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**
Eligible PEA : **Oui**
Frais d'entrée (maximum) : **2,00%**
Frais courants : **0,77%**

Données Clés - Fonds à formule (Source : Amundi)

Date de lancement : **22/04/2022**
Durée de vie :
8 ans (hors cas de remboursement automatique anticipé)
Date d'échéance : **18/04/2030**
Nature de la protection : **Aucune**
Date De Sortie Conditionnelle : **22/04/2024**
22/04/2026
21/04/2028

Profil de risque et de rendement (SRRI) (Source : Fund Admin)

1 2 3 **4** 5 6 7

A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible
A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

Le SRRI correspond au profil de risque et de rendement présent dans le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (DICI). La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Il n'est pas garanti et pourra évoluer dans le temps.
En cas de rachat avant l'échéance, le porteur prend un risque non mesurable à priori, le prix de vente étant fonction des marché ce jour-là. Le prix pourra être très différent (inférieur ou supérieur) du montant résultant de l'application de la formule.

Objectif d'investissement

Ce fonds est une alternative à un investissement risqué de type purement « actions », et présente un risque de perte en capital.

Sélection Euro Environnement (Janvier 2022) est un fonds à formule dont la performance dépend de l'évolution de l'indice Euronext® CDP Environment Eurozone EW Decrement 3.75% (« l'Indice »), indice boursier composé des 50 entreprises aux meilleures pratiques environnementales (sur la base des notations de l'organisme indépendant CDP) parmi les 200 plus grandes capitalisations de l'indice Euronext Eurozone 300.
L'objectif est de bénéficier :

- A horizon 2 ans, le **22 avril 2024**, si la Performance 2 Ans (1) de l'Indice est positive ou nulle, de la Valeur Liquidative de Référence (2) majorée d'un gain fixe (3) de 8%(4) (soit un taux de rendement annuel de 3,92%4)) ;
- Sinon, à horizon 4 ans, le **22 avril 2026**, si la Performance 4 Ans (1) de l'Indice est positive ou nulle, de la Valeur Liquidative de Référence (2) majorée d'un gain fixe (3) de 16%(4) (soit un taux de rendement annuel de 3,78%(4)) ;
- Sinon, à horizon 6 ans, le **21 avril 2028**, si la Performance 6 Ans (1) de l'Indice est positive ou nulle, de la Valeur Liquidative de Référence (2) majorée d'un gain fixe (3) de 24%(4) (soit un taux de rendement annuel de 3,65%4)) ;
- Sinon, à horizon 8 ans, le **18 avril 2030**:
- si la Performance 8 Ans (1) de l'Indice est négative ET si l'Indice a baissé(1) de plus de 40% à l'issue des 8 ans, de la Valeur Liquidative de Référence (2) diminuée de l'intégralité de la baisse de l'Indice (4). **L'investisseur subit alors une perte en capital égale à l'intégralité de la baisse de l'indice** ;
- si la Performance 8 Ans de l'Indice est négative ET si l'Indice n'a pas baissé de plus de 40% à l'issue des 8 ans, de la Valeur Liquidative de Référence (2) (4) ;
- si la Performance 8 Ans de l'Indice est positive ou nulle, de la Valeur Liquidative de Référence (2) majorée d'un gain fixe (3) de 32%(4) (soit un taux de rendement annuel de 3,54%4)).

En cas de sortie anticipée (hors échéance conditionnelle réalisée à 2, 4 ou 6 ans du fait de la stabilité ou de la progression de l'Indice), la valeur de votre placement sera fonction des conditions de marché ce jour-là, avec une éventuelle perte en capital non mesurable a priori. Des frais de sortie seront par ailleurs appliqués : 1%.

(1) Définition précise au paragraphe « *Description de la formule* » du Prospectus du fonds.
(2) La Valeur Liquidative de Référence correspond à la plus haute valeur liquidative du FCP (hors frais d'entrée) établie entre le 6 janvier 2022 inclus et le 22 avril 2022 inclus.
(3) Appliqué à la Valeur Liquidative de Référence.
(4) Hors frais d'entrée (CTO/PEA/PERI CTO), hors frais du contrat d'assurance vie (frais sur versement, frais d'arbitrage, frais de gestion et cotisation de la garantie décès) et de la fiscalité liée au cadre d'investissement

Sélection Euro Environnement (Janvier 2022) constitue une alternative à un investissement risqué de type purement « actions ».
En souscrivant à ce fonds, l'investisseur accepte de plafonner ses gains éventuels à un montant fixe prédéterminé en contrepartie d'une protection en cas de baisse à échéance de l'Indice jusqu'à 40%. En cas de baisse de l'Indice de plus de 40% à l'échéance de 8 ans, l'investisseur subira l'intégralité de la baisse de l'Indice.
La durée de vie maximum du fonds est de 8 ans avec une sortie conditionnelle à 2, 4 ou 6 ans en fonction de l'évolution de l'Indice. L'investisseur doit donc disposer d'un horizon de placement de 8 ans. Les performances du fonds sont plafonnées.

Communication à caractère publicitaire

Valeur Liquidative (Source : Fund Admin)

VL de référence * : **100,00**
Date VL encours FAF : **29/02/2024**
VL : **106,3540**
Evolution depuis l'origine : **6,35%**

NB : L'évolution de la valeur liquidative en cours de vie ne reflète pas la performance finale offerte par le placement. Ce fonds bénéficie d'un objectif à l'échéance défini dans les documents contractuels. Il est important de conserver ce support jusqu'à l'échéance pour bénéficier de la formule.

* La valeur liquidative de référence correspond au prix d'une part au lancement de la formule (hors frais).

STRUCTURÉ ■

Frais de sortie (source : Amundi)

A l'échéance : néant

Entre le 6 janvier 2022 et le 22 avril 2022: néant

1,00 % aux autres dates

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. 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.

SELECTION EURO ENVIRONNEMENT (JANVIER 2022)

REPORTING

Communication Publicitaire
29/02/2024

STRUCTURÉ ■

APPROCHE ESG RETENUE

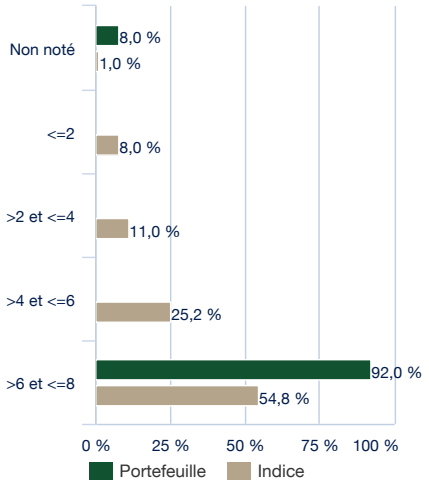
Le fonds est géré de manière indicielle par rapport à l'Indice par le biais d'une réplication directe en investissant environ 100% de son actif dans les actions de l'Indice aux Dates de Constatation Initiale (1) et en restant à tout moment investi dans les actions de l'Indice. Le Fonds contracte également 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.

L'OPCVM est classé article 8 au sens du 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 en sélectivité par rapport à son univers d'investissement, le SBF 120, en excluant au minimum 20% des entreprises les moins respectueuses de l'environnement. Au minimum 90% des titres en portefeuille bénéficient d'une notation sur des critères extra-financiers.
Limitations de l'approche retenue : l'approche en sélectivité n'exclut aucun secteur d'activité à priori et l'OPCVM peut ainsi être exposé à certains secteurs controversés. Le fonds intègre le facteur environnement dans son processus d'investissement à l'exclusion des autres facteurs de durabilité.

Commentaire de gestion

Conformément à la stratégie d'investissement, le gérant du fonds modifie la composition du portefeuille d'actions en cas de révision de l'indice sous-jacent. Il n'y a pas eu d'opération notable sur le portefeuille d'actions sur le mois écoulé.

Distribution des notations environnement de CDP* des actions



Notation des actions en portefeuille

	Portefeuille	Notation environnement de CDP*
CARL ZEISS MEDITEC	2,36%	7,00
KBC GROUP NV	2,33%	8,00
SCHNEIDER ELECT SE	2,32%	7,00
SAP SE / XETRA	2,31%	7,00
MONCLER SPA	2,30%	7,00
CAPGEMINI SE	2,29%	8,00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,28%	8,00
METSO CORP	2,27%	7,00
DSM-FIRMENICH AG	2,25%	
ASSICURAZIONI GENERALI	2,25%	7,00
AIB GROUP PLC	2,24%	7,00
INTESA SANPAOLO	2,17%	8,00
AENA SME SA	2,16%	8,00
GEA GROUP AG	2,14%	7,50
KONINKLIJKE KPN NV	2,14%	8,00
CAIXABANK SA	2,13%	8,00
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD /PARIS	2,13%	8,00
FERROVIAL SE	2,10%	
AIR LIQUIDE PRIME DE FIDELITE 2025	2,09%	7,00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	2,06%	
POSTE ITALIANE SPA	2,06%	7,00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,01%	8,00
TELEFONICA SA	1,99%	8,00
ELISA OYJ	1,99%	7,00
L OREAL PRIME DE FIDELITE 2025	1,98%	8,00
KLEPIERRE	1,98%	8,00
DANONE	1,98%	8,00
BANCO SANTANDER SA	1,97%	8,00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,95%	8,00
HEINEKEN NV	1,94%	7,50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,94%	8,00
VALMET OYJ	1,93%	7,00
DEUTSCHE TELEKOM NAM (XETRA)	1,91%	8,00
ORANGE	1,89%	7,00
GR BRUXELLES LAMBERT	1,88%	7,00
REDEIA CORP SA	1,88%	8,00
JERONIMO MARTINS	1,87%	7,70
E.ON SE	1,86%	8,00
CELLNEX TELECOM SA	1,86%	8,00
STMICROELECTRONICS/P	1,85%	7,00
SNAM SPA	1,83%	7,00
CARREFOUR SA	1,82%	7,00
GETLINK SE	1,80%	7,00
IBERDROLA SA	1,77%	7,00
ENEL SPA	1,77%	7,00
DEUTSCHE LUFTHANSA	1,75%	7,00
GECINA SA	1,66%	8,00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,63%	8,00
EDP RENOVAVEIS	1,53%	
WORLDLINE SA	1,40%	7,00

*Euronext calcule une notation Environnement pour chaque entreprise en se basant sur la moyenne de ses notes CDP sur les thèmes pour lesquels elle a été sollicitée. C'est sur cette note Euronext que sont sélectionnées les 40 entreprises les plus respectueuses de l'environnement qui composeront l'indice Euronext® CDP Environment France EW Decrement 5%.