

# AMUNDI S&P 500 ESG UCITS ETF - Acc EUR HEDGED

ACTIONS ■

REPORTING

Communication  
Publicitaire

30/04/2024

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **73,02 ( EUR )**  
Date de VL et d'actif géré : **30/04/2024**  
Actif géré : **4 226,16 ( millions EUR )**  
Code ISIN : **IE00058MW3M8**  
Type de Réplication : **Physique**  
Indice de référence :  
**100% S&P 500 ESG+ EUR HEDGED INDEX**

## Objectif d'investissement

Le Compartiment a pour objectif de répliquer la performance de l'Indice S&P 500 ESG+ (l'« Indice »). Le Compartiment vise à atteindre un niveau d'écart de suivi du Compartiment et de son Indice qui ne dépassera normalement pas 1 %.

## Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



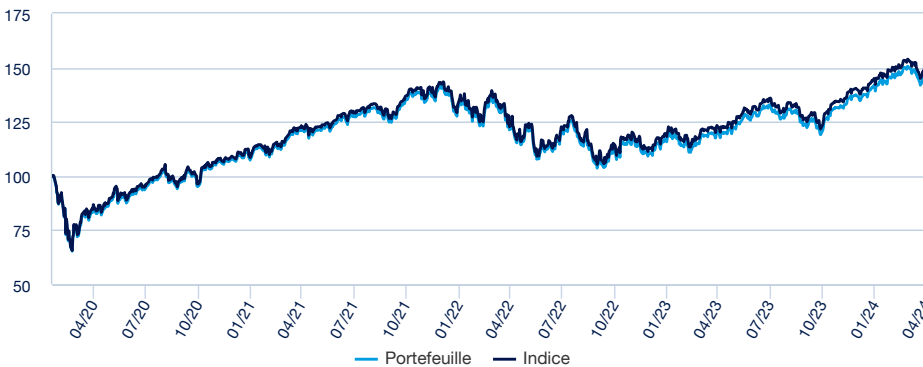
Risque le plus faible

Risque le plus élevé

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

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

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



### Performances glissantes \* (Source : Fund Admin)

| Depuis le    | Depuis le<br>29/12/2023 | 1 mois<br>28/03/2024 | 3 mois<br>31/01/2024 | 1 an<br>28/04/2023 | 3 ans<br>30/04/2021 | 5 ans<br>- | Depuis le<br>17/02/2020 |
|--------------|-------------------------|----------------------|----------------------|--------------------|---------------------|------------|-------------------------|
| Portefeuille | 5,59%                   | -3,89%               | 4,02%                | 19,93%             | 19,71%              | -          | 44,79%                  |
| Indice       | 5,59%                   | -3,87%               | 4,03%                | 19,98%             | 20,96%              | -          | 47,97%                  |
| Ecart        | 0,00%                   | -0,02%               | 0,00%                | -0,04%             | -1,25%              | -          | -3,18%                  |

### Performances calendaires \* (Source : Fund Admin)

|              | 2023   | 2022    | 2021   | 2020 | 2019 |
|--------------|--------|---------|--------|------|------|
| Portefeuille | 23,94% | -21,18% | 30,36% | -    | -    |
| Indice       | 24,16% | -20,68% | 30,77% | -    | -    |
| Ecart        | -0,22% | -0,50%  | -0,41% | -    | -    |

### Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

|                            | 1 an   | 3 ans  | Depuis le<br>lancement * |
|----------------------------|--------|--------|--------------------------|
| Volatilité du portefeuille | 12,74% | 16,97% | 21,37%                   |
| Volatilité de l'indice     | 12,74% | 17,09% | 21,63%                   |
| Tracking Error ex-post     | 0,14%  | 0,38%  | 0,70%                    |
| Ratio de sharpe            | 1,39   | 0,31   | 0,43                     |

\* 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

\* 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 impactés par les fluctuations des taux de change (à la hausse comme à la baisse). L'écart correspond à la différence de performance du portefeuille et de l'indice.

ACTIONS ■

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'indice S&P 500 ESG+ (l'« Indice ») est un indice élargi pondéré par la capitalisation boursière qui mesure la performance des titres qui répondent aux critères de durabilité, tout en conservant une pondération globale au niveau sectoriel similaire à celle de l'indice S&P 500 (l'« Indice cadre »). L'indice S&P 500 est un indice d'actions représentatif des titres de premier plan négociés aux États-Unis.

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Actions**  
Exposition : **Amérique du Nord**

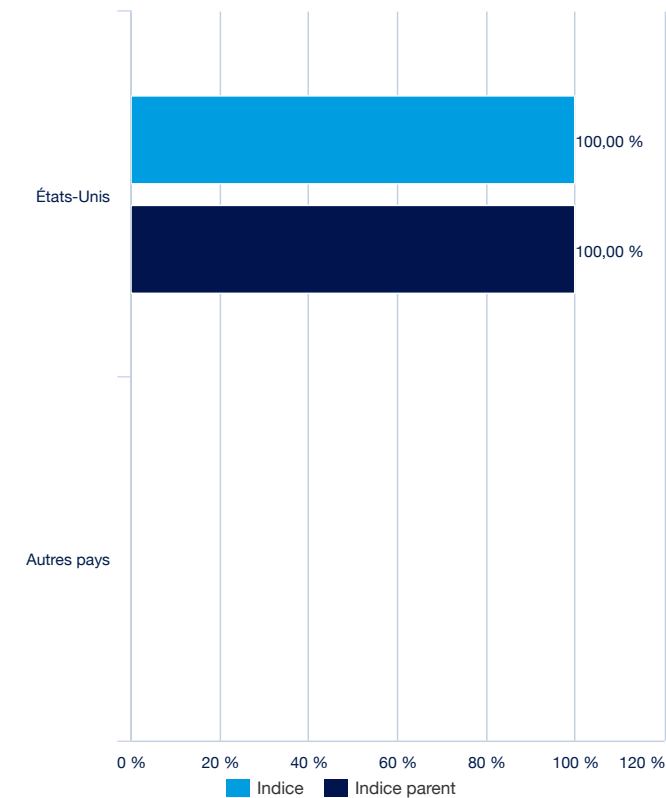
Nombre de valeurs : **305**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

|                     | % d'actifs (indice) | % d'actifs (Indice parent) |
|---------------------|---------------------|----------------------------|
| MICROSOFT CORP      | 9,41 %              | 6,97 %                     |
| APPLE INC           | 7,93 %              | 5,87 %                     |
| NVIDIA CORP         | 6,82 %              | 5,05 %                     |
| AMAZON.COM INC      | 5,21 %              | 3,85 %                     |
| ALPHABET INC CL A   | 3,08 %              | 2,28 %                     |
| ALPHABET INC CL C   | 2,61 %              | 1,93 %                     |
| ELI LILLY & CO      | 1,85 %              | 1,37 %                     |
| JPMORGAN CHASE & CO | 1,76 %              | 1,30 %                     |
| TESLA INC           | 1,69 %              | 1,25 %                     |
| EXXON MOBIL CORP    | 1,50 %              | 1,11 %                     |
| <b>Total</b>        | <b>41,85 %</b>      | <b>30,99 %</b>             |

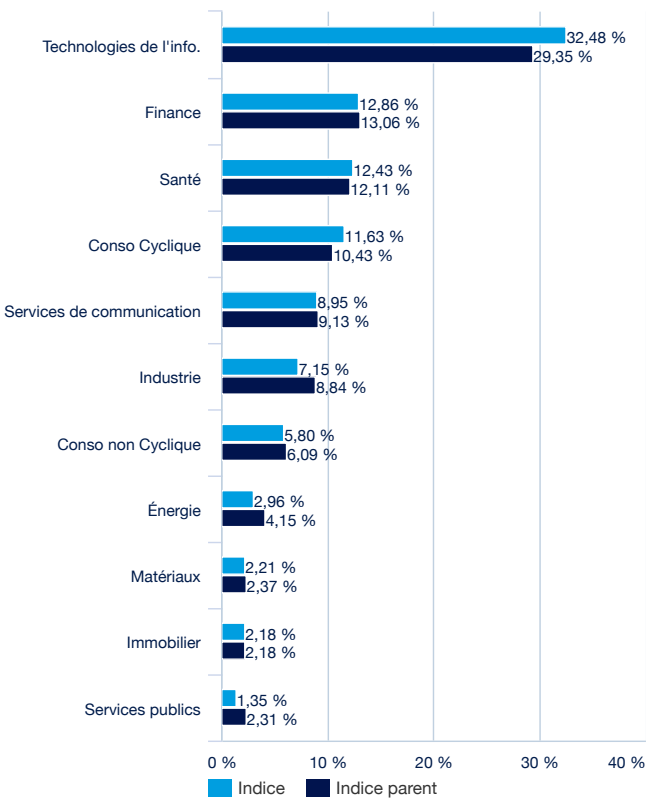
Indice parent : **S&P 500**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **S&P 500**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **S&P 500**

ACTIONS

Investissement Socialement Responsable (ISR)

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

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

Evaluation par critère ESG (Source : Amundi)

|               | Indice | Indice parent |
|---------------|--------|---------------|
| Note Globale  | 6,82   | 6,58          |
| Environnement | 6,99   | 6,84          |
| Social        | 5,19   | 5,04          |
| Gouvernance   | 5,38   | 5,47          |

Indice parent : S&P 500

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)

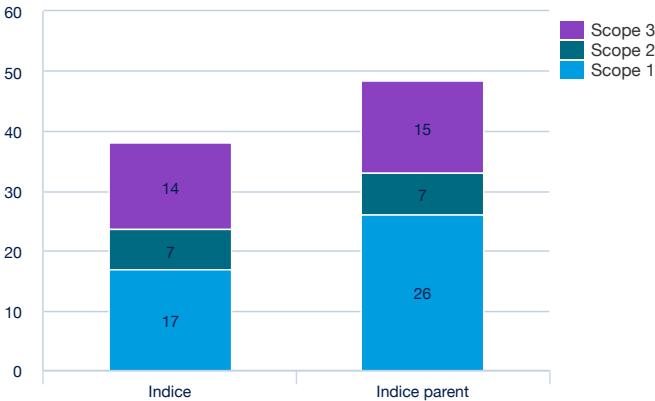
«G» pour Gouvernance (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

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) : | 38,72  | 49,00         |



Indice parent : S&P 500

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 chaîne 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 influencer.

Source : Les données sur émissions carbonees 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



ACTIONS ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

|                                                                   |                                        |
|-------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| Forme juridique                                                   | ICAV de droit Irlandais                |
| Norme européenne                                                  | OPCVM                                  |
| Société de gestion                                                | Amundi Ireland Limited                 |
| Valorisateur                                                      | HSBC Securities Services (Ireland) DAC |
| Dépositaire                                                       | HSBC Continental Europe                |
| Commissaire aux comptes                                           | PRICEWATERHOUSECOOPERS                 |
| Date de création de la classe                                     | 17/10/2023                             |
| Date de la première VL                                            | 17/02/2020                             |
| Devise de référence de la classe                                  | EUR                                    |
| Classification AMF                                                | -                                      |
| Affectation des sommes distribuables                              | Capitalisation                         |
| Code ISIN                                                         | IE00058MW3M8                           |
| Minimum de souscription marché secondaire                         | 1 Part(s)                              |
| Périodicité de calcul de la VL                                    | Quotidienne                            |
| Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation | 0,28%                                  |
| 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 | -                    | EUR    | S500H | S500H FP         | -              | S500H.PA    | -                |
| Borsa Italiana      | -                    | EUR    | S500H | S500H IM         | IMSEURIV       | S500H.MI    | IMS500HINAV=SOLA |

Contact

Contact ETF vente

|                         |                       |
|-------------------------|-----------------------|
| France & Luxembourg     | +33 (0)1 76 32 65 76  |
| Allemagne & Autriche    | +49 (0) 800 111 1928  |
| Italie                  | +39 02 0065 2965      |
| Suisse (Allemand)       | +41 44 588 99 36      |
| Suisse (Français)       | +41 22 316 01 51      |
| Royaume-Uni             | +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<br>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

## ACTIONS ■

## Fournisseurs d'indices

LE COMPARTIMENT AMUNDI S&P 500 ESG N'EST EN AUCUNE FAÇON SPONSORISÉ, AVALISÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES AFFILIÉS (« S&P »). S&P N'ÉMET AUCUNE DÉCLARATION, CONDITION OU GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ATTENTION DES PORTEURS DE PARTS DU COMPARTIMENT OU DE TOUT MEMBRE DU PUBLIC QUANT À L'OPPORTUNITÉ D'UN INVESTISSEMENT DANS DES TITRES EN GÉNÉRAL OU DANS LE COMPARTIMENT EN PARTICULIER OU QUANT À LA CAPACITÉ DE L'INDICE S&P 500 ESG À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU SEGMENTS DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU DE GROUPES OU CATÉGORIES D'ACTIFS. L'UNIQUE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI REPOSE SUR L'OCTROI SOUS LICENCE DE CERTAINES MARQUES DÉPOSÉES, NOMS COMMERCIAUX ET DE L'INDICE S&P 500 ESG, QUI EST DÉFINI, CONSTITUÉ ET CALCULÉ PAR S&P SANS TENIR COMPTE D'AMUNDI NI DU COMPARTIMENT. S&P N'EST NULLEMENT TENUE DE PRENDRE EN COMPTE LES BESOINS D'AMUNDI LORS DE LA DÉFINITION, DE LA COMPOSITION OU DU CALCUL DE L'INDICE S&P 500 ESG. S&P N'EST RESPONSABLE NI DE LA DÉTERMINATION DES COURS ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, NI DU CALENDRIER D'ÉMISSION/DE VENTE DE SES TITRES, PAS PLUS QUE DE LA DÉFINITION OU DU CALCUL DE L'ÉQUATION PERMETTANT LA CONVERSION EN NUMÉRAIRE DE SES ACTIONS, TOUTES ACTIVITÉS AUXQUELLES L'AGENCE NE PREND AUCUNE PART. 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 NI L'EXHAUSTIVITÉ DE L'INDICE S&P 500 ESG, NI DES DONNÉES Y FIGURANT, ET NE PEUT ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION S'Y RAPPORTANT. S&P NE DONNE AUCUNE GARANTIE, NE POSE AUCUNE CONDITION NI NE FORMULE AUCUNE DÉCLARATION, EXPRESSEMENT OU IMPLICITEMENT, QUANT AUX RÉSULTATS DEVANT ÊTRE OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, ET PROVENANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE S&P 500 ESG OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. S&P NE DONNE AUCUNE ESPÈCE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, Y COMPRIS CONCERNANT TOUTE QUALITÉ MARCHANDE OU ADÉQUATION À UN OBJET OU USAGE PARTICULIER, AU TITRE DE L'INDICE S&P 500 ESG OU DES DONNÉES Y FIGURANT. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTS DOMMAGES SPÉCIAUX, PUNITIFS, INDIRECTS OU CONSÉCUTIFS (Y COMPRIS TOUTE PERTE DE BÉNÉFICES), RÉSULTANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE S&P 500 ESG OU DE TOUTE DONNÉE Y FIGURANT, MÊME SI ELLE A ÉTÉ AVERTIE DE LA POSSIBILITÉ DE SURVENANCE 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.

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.