

# Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned UCITS ETF

ACTIONS ■

REPORTING

Communication  
Publicitaire

30/09/2026

## Objectif d'investissement

Ce Compartiment est géré passivement. L'objectif de ce Compartiment est de répliquer la performance de l'Indice MSCI Emerging Markets SRI filtered PAB (l'« Indice ») et de minimiser l'écart de suivi entre la valeur nette des actifs du Compartiment et la performance de l'Indice. Le niveau prévu d'écart de suivi dans des conditions normales du marché est indiqué dans le prospectus du Compartiment. L'Indice est un Indice de rendement total : les dividendes nets d'impôt payés par les composants de l'Indice sont inclus dans le rendement de l'Indice. Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et/ou sociales en répliquant, entre autres, un Indice intégrant une évaluation environnementale, sociale et de gouvernance (ESG). L'Indice est un indice d'actions basé sur l'Indice MSCI Emerging Markets, représentatif des actions à grande et moyenne capitalisation de 27 pays émergents (à partir de novembre 2021) (l'« Indice parent »). L'Indice offre une exposition aux sociétés ayant des notations ESG exceptionnelles et exclut les sociétés dont les produits ont une incidence sociale ou environnementale négative. En outre, l'Indice vise à représenter la performance d'une stratégie qui répondra les titres en fonction des opportunités et des risques associés à la transition climatique, afin de répondre aux exigences minimales du Règlement de l'UE sur les Indices de référence de l'Accord de Paris (EU PAB). Les enjeux ESG clés comprennent principalement l'intensité carbone. Pour de plus amples informations concernant les exclusions appliquées par l'Indice conformément aux indices de référence de l'UE alignés sur l'Accord de Paris (ou PAB), veuillez consulter la section du Prospectus intitulée « Directives concernant les dénominations des fonds contenant des termes liés aux critères ESG ou à la durabilité ». Les limites de l'approche adoptée sont décrites dans le prospectus du Compartiment par le biais de facteurs de risque tels que le risque d'investissement durable. Le score ESG des sociétés est calculé par une agence de notation ESG, à l'aide de données brutes, de modèles et d'estimations recueillies/calculées à l'aide de méthodes spécifiques à chaque fournisseur. En raison du manque de normalisation et du caractère unique de chaque méthodologie, les informations fournies peuvent être incomplètes. Il s'avère complexe d'évaluer les risques en matière de développement durable qui reposent sur des données ESG difficiles à obtenir, incomplètes, estimées, obsolètes et/ou sensiblement inexactes. Même lorsque ces données sont identifiées, rien ne permet de garantir qu'elles seront correctement évaluées. L'exposition à l'Indice sera obtenue par le biais d'une réplification directe, principalement en investissant directement dans des valeurs mobilières et/ou d'autres actifs éligibles représentant les composants de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice. Le Gestionnaire d'investissement pourra utiliser des instruments dérivés afin de gérer les flux entrants et sortants et également si cela permet une meilleure exposition à un composant de l'Indice. Afin de générer des revenus supplémentaires pour compenser ses coûts, le Compartiment peut également conclure des opérations de prêt de titres.

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



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

| Depuis le    | Depuis le<br>31/12/2025 | 1 mois<br>31/08/2026 | 3 mois<br>30/06/2026 | 1 an<br>30/09/2025 | 3 ans<br>29/09/2023 | 5 ans<br>30/09/2021 | Depuis le<br>22/01/2019 |
|--------------|-------------------------|----------------------|----------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------------------|
| Portefeuille | 18,03%                  | 0,41%                | 1,68%                | 20,01%             | 65,48%              | 27,12%              | 65,65%                  |
| Indice       | 18,46%                  | 0,47%                | 1,78%                | 20,61%             | 67,98%              | 29,90%              | 71,55%                  |
| Ecart        | -0,43%                  | -0,06%               | -0,10%               | -0,60%             | -2,50%              | -2,78%              | -5,90%                  |

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

|              | 2025   | 2024   | 2023   | 2022    | 2021   | 2020   | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 |
|--------------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|------|------|------|------|
| Portefeuille | 27,83% | 4,22%  | 1,87%  | -18,41% | -1,64% | 17,48% | -    | -    | -    | -    |
| Indice       | 28,38% | 4,93%  | 2,25%  | -18,26% | -1,27% | 17,72% | -    | -    | -    | -    |
| Ecart        | -0,56% | -0,70% | -0,38% | -0,15%  | -0,38% | -0,24% | -    | -    | -    | -    |

\* Source : Amundi. Les performances nettes 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 garanties 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.

## Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

|                            | 1 an   | 3 ans  | Depuis le<br>lancement * |
|----------------------------|--------|--------|--------------------------|
| Volatilité du portefeuille | 17,53% | 15,82% | 18,82%                   |
| Volatilité de l'indice     | 17,53% | 15,84% | 18,87%                   |
| Tracking Error ex-post     | 0,21%  | 0,28%  | 0,35%                    |
| Ratio de sharpe            | 1,06   | 0,87   | 0,19                     |

\* 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

## Notation Morningstar ©

Notation Morningstar "Overall" © : **2 étoiles**  
Catégorie Morningstar © :  
**EAA FUND GLOBAL EMERGING MARKETS EQUITY**  
Date de notation : **31/08/2026**  
Nombre de fonds de la catégorie : **3103**

## ACTIONS ■

## 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.

Nous avons classé ce produit dans la catégorie de risque 4 sur 7, qui est une catégorie de risque moyenne. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau moyen et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est possible que notre capacité à vous payer en soit affectée. Risques supplémentaires : Le risque de liquidité du marché peut accentuer la variation des performances du produit. Ce produit ne prévoyant pas de protection contre les aléas de marché, vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement. Outre les risques inclus dans l'indicateur de risque, d'autres risques peuvent influencer sur la performance du Compartiment. Veuillez vous reporter au prospectus d'Amundi Index Solutions.

## Caractéristiques (source : Amundi)

|                                                                     |                                        |
|---------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| VL                                                                  | C : 82,83 USD<br>D : 71,12 USD         |
| Actif géré                                                          | 3 191,11 ( millions USD )              |
| Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation * | 0,25%                                  |
| Date de VL et d'actif géré                                          | 30/09/2026                             |
| Code ISIN                                                           | C : LU1861138961<br>D : LU2059756754   |
| Type de Réplication                                                 | Physique                               |
| Indice de référence                                                 | 100% MSCI EM SRI FILTERED PAB          |
| Affectation des sommes distribuables                                | (C) Capitalisation<br>(D) Distribution |
| Date du dernier coupon                                              | 09/12/2025 ( USD )                     |
| Dernier dividende                                                   | 1,1500 ( USD )                         |
| Forme juridique                                                     | SICAV de droit Luxembourgeois          |
| Norme européenne                                                    | OPCVM                                  |
| Société de gestion                                                  | Amundi Luxembourg SA                   |
| Teneur marché principal                                             | BNP Paribas                            |
| Valorisateur                                                        | CACEIS Bank, Luxembourg Branch         |
| Dépositaire                                                         | CACEIS Bank, Luxembourg Branch         |
| Commissaire aux comptes                                             | DELOITTE AUDIT                         |
| Date de création de la classe                                       | 16/01/2019                             |
| VL de lancement                                                     | 50,00 ( USD )                          |
| Date de la première VL                                              | 22/01/2019                             |
| Devise de référence de la classe                                    | USD                                    |
| Minimum de souscription marché secondaire                           | 1 Part(s)                              |
| Périodicité de calcul de la VL                                      | Quotidienne                            |
| Durée minimum d'investissement recommandée                          | 5 ans                                  |
| Clôture fiscale                                                     | Septembre                              |

\* Pour plus d'informations concernant l'ensemble des coûts supportés par le fonds, veuillez vous référer à son Document d'Informations Clés (DIC). Des coûts de transaction et des commissions peuvent être appliqués dans le cadre de la négociation d'ETF.

## ACTIONS ■

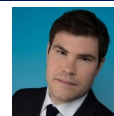
## Rencontrez l'équipe

**Lionel Brafman**

Responsable Gestion Indicielle &amp; Multistratégie

**Zhicong Mou**

Gérant de Portefeuille - Index &amp; Multistratégies

**Arnaud Vergonjeanne**

Gérant suppléant

## Données de l'indice (Source : Amundi)

## Description de l'indice

L'Indice MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB est un indice d'actions basé sur l'Indice MSCI Emerging Markets représentatif des titres de moyenne à grande capitalisation de 26 pays émergents (en novembre 2021) (l'« Indice parent »). L'Indice offre une exposition aux sociétés assorties de notations exceptionnelles en matière environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) 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)

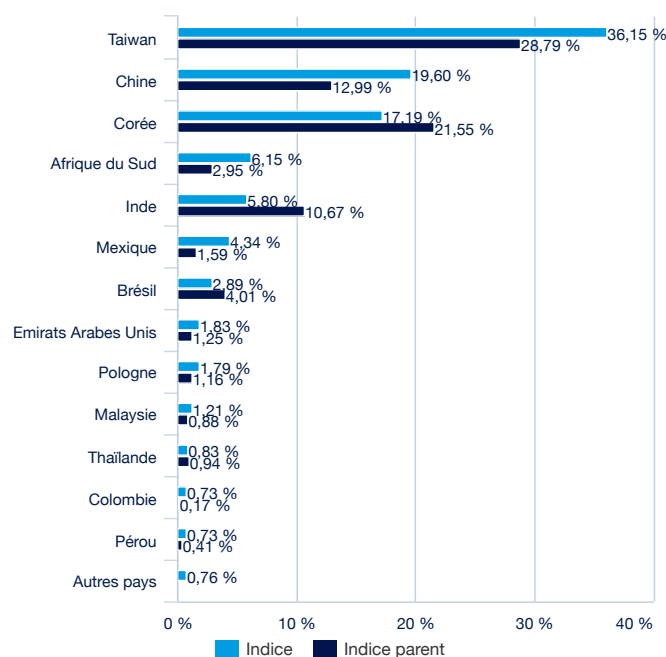
Classe d'actif : **Actions**Exposition : **Emergents**Devise de référence de l'indice : **USD**Nombre de valeurs : **140**

## Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

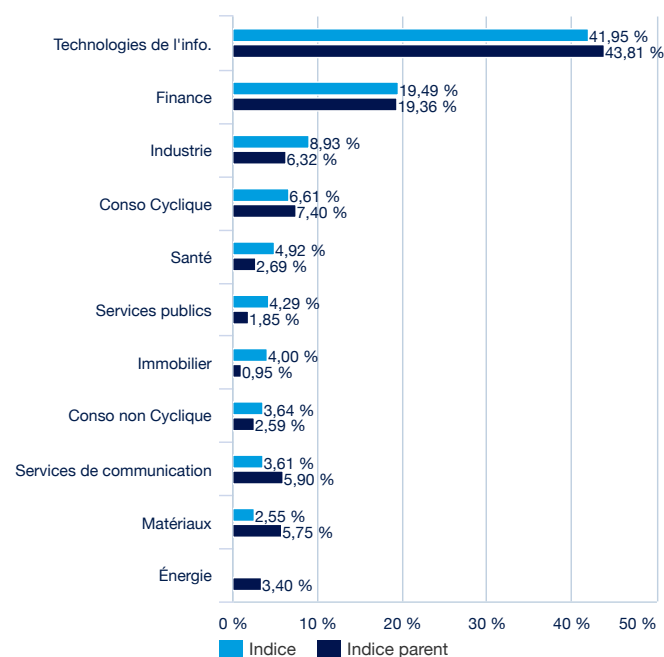
|                              | % d'actifs (indice) | % d'actifs (Indice parent) |
|------------------------------|---------------------|----------------------------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 15,40%              | 15,58%                     |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 5,63%               | 0,44%                      |
| SAMSUNG EL MECHANICS         | 5,46%               | 0,51%                      |
| DELTA ELECTRONICS INC        | 5,04%               | 0,91%                      |
| ASIA VITAL COMPONENTS        | 3,64%               | 0,28%                      |
| SK SQUARE CO LTD             | 2,58%               | 0,62%                      |
| SAMSUNG SDI CO LTD           | 2,11%               | 0,19%                      |
| NETEASE INC                  | 2,07%               | 0,35%                      |
| CHINA CONSTRUCT BANK         | 1,88%               | 0,85%                      |
| NASPER LTD-N SHS             | 1,63%               | 0,26%                      |
| <b>Total</b>                 | <b>45,43%</b>       | <b>20,01%</b>              |

Indice parent : **MSCI EMERGING MARKETS**

## Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)

Indice parent : **MSCI EMERGING MARKETS**

## Secteurs de l'indice (source : Amundi)

Indice parent : **MSCI EMERGING MARKETS**

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  | 8,17   | 6,74          |
| Environnement | 6,97   | 6,06          |
| Social        | 6,04   | 5,48          |
| Gouvernance   | 6,07   | 5,42          |

Indice parent : MSCI EMERGING MARKETS

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)

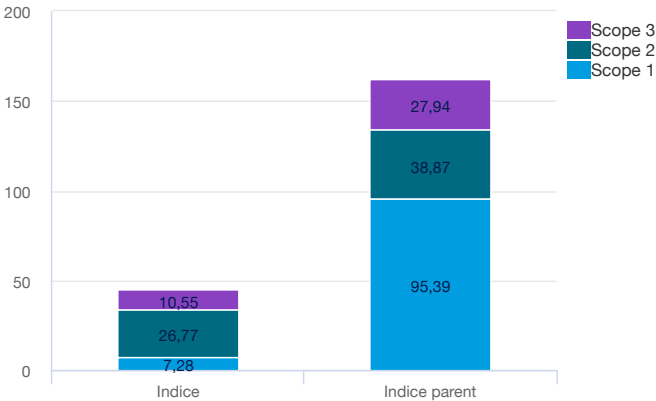
«G» pour Gouvernance (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

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

Empreinte Carbone

Empreinte carbone par million d'euros investis

|                                             | Indice | Indice parent |
|---------------------------------------------|--------|---------------|
| Total en tCO2 / M€ (Indice/Indice parent) : | 45,53  | 164,37        |



Indice parent : MSCI EMERGING MARKETS

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** : Toutes les autres émissions indirectes, en amont et en aval de la chaîne de valeur. Pour des raisons de robustesse des données, Amundi a choisi d'utiliser les émissions provenant des activités en amont du scope 3 - Source : modèle EEI-O Trucost (modèle d'entrée/sortie étendu à l'environnement de Trucost).

Source : Les données sur émissions carbone 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.

## ACTIONS ■

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

| Place de cotation       | Devise | Ticker Bloomberg | iNAV Bloomberg | RIC Reuters | iNAV Reuters      |
|-------------------------|--------|------------------|----------------|-------------|-------------------|
| Six Swiss Exchange      | USD    | EMSRI SW         | EMSRIUIV       | EMSRI.S     | EMSRIUSDINAV=SOLA |
| Deutsche Boerse (Xetra) | EUR    | AMEI GY          | EMSRIEIV       | AMEI.DE     | EMSRIEURINAV=SOLA |
| Euronext Paris          | EUR    | EMSRI FP         | EMSRIEIV       | EMSRI.PA    | EMSRIEURINAV=SOLA |
| LSE                     | USD    | MSRU LN          | EMSRIUIV       | MSRU.L      | EMSRIUSDINAV=SOLA |
| LSE                     | GBP    | MSRG LN          | -              | MSRG.L      | -                 |
| Euronext Milan          | EUR    | EMSRI IM         | EMSRIEIV       | EMSRI.MI    | EMSRIEURINAV=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 (Retail) | +44 (0) 20 7 074 9598 |
| Royaume-Uni (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-etf@amundi.com