

AMUNDI MSCI USA ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB UCITS ETF Dist

REPORTING

Communication Publicitaire

31/03/2024

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **458,18 (EUR)**
 Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**
 Actif géré : **3 601,42 (millions EUR)**
 Code ISIN : **IE000QQ8Z0D8**
 Type de Réplication : **Physique**
 Indice de référence :
100% MSCI USA ESG BROAD CTB SELECT

Objectif d'investissement

Le Compartiment a pour objectif de répliquer la performance de l'Indice MSCI USA ESG Broad CTB Select (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)



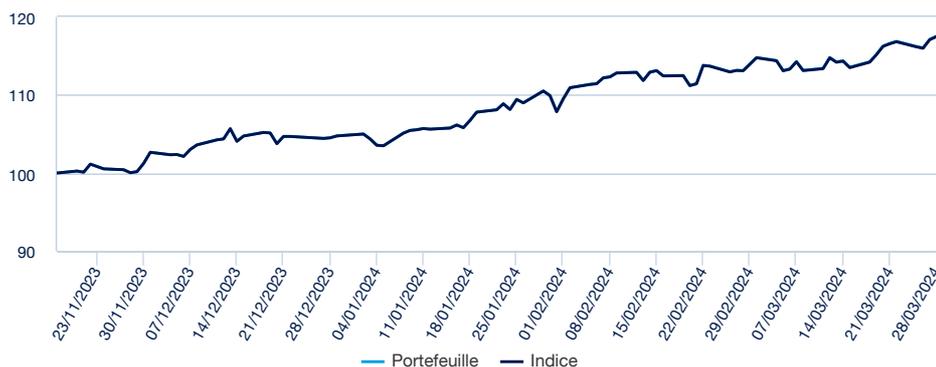
Risque le plus faible

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)



Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	11,04%	15,26%	18,13%
Volatilité de l'indice	11,04%	15,26%	18,14%
Tracking Error ex-post	0,05%	0,06%	0,97%
Ratio de sharpe	2,32	0,71	0,52

* 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 29/02/2024	3 mois 29/12/2023	1 an 31/03/2023	3 ans 31/03/2021	5 ans 29/03/2019	Depuis le 23/03/2006
Portefeuille	12,18%	3,12%	12,18%	29,13%	42,34%	99,90%	478,86%
Indice	12,14%	3,10%	12,14%	29,15%	42,36%	99,07%	425,05%
Ecart	0,04%	0,02%	0,04%	-0,02%	-0,02%	0,82%	53,81%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portefeuille	21,50%	-15,89%	-	-	-
Indice	21,60%	-15,86%	-	-	-
Ecart	-0,09%	-0,04%	-	-	-

* 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 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 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.

ACTION ■

Rencontrez l'équipe



Lionel Brafman
Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie



Christophe Neves
Gérant de portefeuille principal



Eric Alcaraz
Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice est un indice d'actions basé sur l'Indice MSCI USA, représentatif des segments à grande et moyenne capitalisation du marché américain (l'« Indice parent »). L'indice exclut les entreprises dont les produits ont des impacts sociaux ou environnementaux négatifs, tout en surpondérant les entreprises ayant un score ESG élevé. 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 réglementaires de l'Indice de référence de transition climatique de l'UE (« UE CTB »). L'Indice est construit en appliquant une combinaison d'exclusions basées sur des valeurs et un processus d'optimisation pour augmenter le score ESG par rapport à l'Indice parent et pour répondre aux exigences minimales de la réglementation UE CTB tout en ciblant un profil de risque similaire à celui de l'Indice parent.

Caractéristiques (Source : Amundi)

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

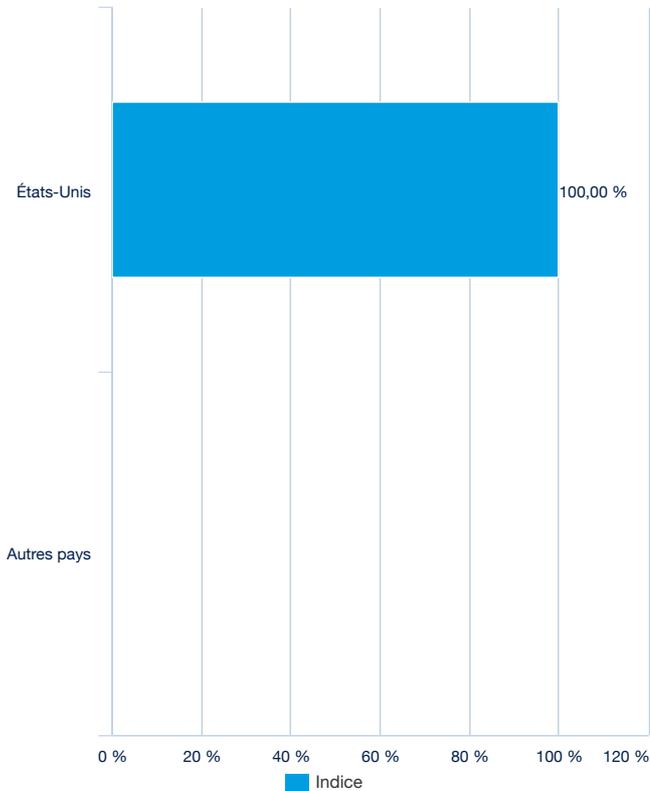
Nombre de valeurs : **545**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
MICROSOFT CORP	6,88%	-
APPLE INC	5,28%	-
NVIDIA CORP	5,05%	-
AMAZON.COM INC	3,50%	-
ALPHABET INC CL C	2,88%	-
META PLATFORMS INC-CLASS A	2,02%	-
ELI LILLY & CO	1,57%	-
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,27%	-
JPMORGAN CHASE & CO	1,22%	-
TEXAS INSTRUMENTS	1,17%	-
Total	30,84%	-

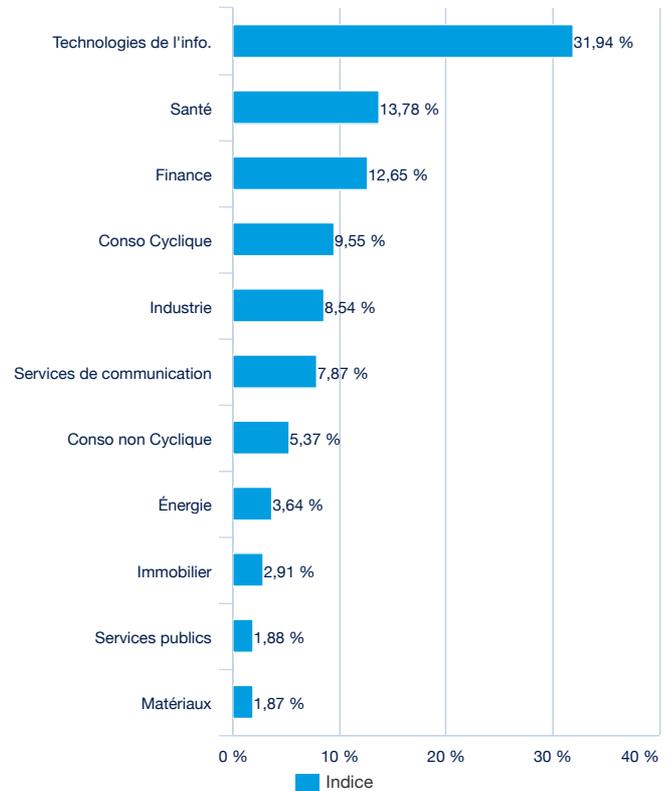
Indice parent :

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Indice parent :

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent :

ACTION

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	16/11/2023
Date de la première VL	23/03/2006
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	-
Affectation des sommes distribuables	Distribution
Code ISIN	IE000QQ8Z0D8
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,09% (Estimés) - 16/11/2023
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Clôture fiscale	Décembre
Teneur marché principal	

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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Deutsche Börse	-	GBP	LYYD	LYYD GY	USALIV	LYYBGBP.DE	USALINAV=SOLA
Deutsche Börse	-	EUR	LYYB	LYYB GY	LUSAIV	LYYB.DE	LUSAINAV=SOLA
Deutsche Börse	-	USD	LYYC	LYYC GY	LYUSAIV	LYYBUSD.DE	LYUSAINAV=SOLA
Borsa Italiana	-	EUR	LUSA	LUSA IM	LUSAIV	LUSA.MI	LUSAINAV=SOLA
Nyse Euronext Paris	-	EUR	USA	USA FP	LUSAIV	USA.PA	LUSAINAV=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
UNITED KINGDOM (Retail)	+44 (0) 20 7 074 9598
UNITED KINGDOM (Insti)	+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

ACTION ■

Fournisseurs d'indices

AMUNDI MSCI USA ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB UCITS ETF (LE « COMPARTIMENT ») N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR MSCI INC. « MSCI ») OU PAR L'UNE DE SES FILIALES, L'UN DE SES FOURNISSEURS D'INFORMATION OU TOUT AUTRE TIERS IMPLIQUÉ DANS LA COMPILATION OU LA CRÉATION D'UN INDICE MSCI (COLLECTIVEMENT, LES « PARTIES MSCI ») OU LIÉ À CES DERNIÈRES ACTIONS. LES INDICES MSCI SONT LA PROPRIÉTÉ EXCLUSIVE DE MSCI ET SONT DES MARQUES DE SERVICE DE MSCI OU DE SES FILIALES. AMUNDI A OBTENU DES LICENCES D'UTILISATION DES INDICES MSCI À CERTAINES FINS. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE FAIT DE DÉCLARATION NI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ÉMETTEUR, AUX PROPRIÉTAIRES DE CE COMPARTIMENT OU À TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ CONCERNANT L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES COMPARTIMENTS EN GÉNÉRAL OU DANS CE COMPARTIMENT EN PARTICULIER, NI QUANT À LA CAPACITÉ DE TOUT INDICE MSCI À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DU MARCHÉ DES ACTIONS CORRESPONDANT. MSCI ET SES FILIALES SONT LES CONCÉDANTES DE LICENCE DE CERTAINES MARQUES DÉPOSÉES, MARQUES DE SERVICE ET NOMS COMMERCIAUX, AINSI QUE DES INDICES MSCI DÉTERMINÉS, COMPOSÉS ET CALCULÉS PAR MSCI, SANS TENIR COMPTE D'AMUNDI, DE CE COMPARTIMENT OU DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, NI DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ.

AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A L'OBLIGATION DE TENIR COMPTE DES BESOINS D'AMUNDI, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ LORS DE LA DÉTERMINATION, DE LA COMPOSITION OU DU CALCUL DES INDICES MSCI. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST RESPONSABLE OU N'A PARTICIPÉ À L'ÉTABLISSEMENT DU CALENDRIER, À LA FIXATION DES PRIX OU À LA DÉTERMINATION DES QUANTITÉS À ÉMETTRE POUR CE COMPARTIMENT, PAS PLUS QU'À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION OU À LA RÉTRIBUTION CONTRE LAQUELLE CE COMPARTIMENT PEUT ÊTRE RACHETÉ. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A LA MOINDRE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ VIS-À-VIS DE L'ÉMETTEUR OU DES PROPRIÉTAIRES DE CE COMPARTIMENT, NI VIS-À-VIS D'AUCUNE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ ASSOCIÉE À L'ADMINISTRATION, À LA COMMERCIALISATION OU 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 QU'ELLE ESTIME FIABLES, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, LA PRÉCISION ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES MSCI OU DE TOUTE DONNÉE INCLUSE. AUCUN CONCÉDANT NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS DÉCOULANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE PAR L'ÉMETTEUR DU COMPARTIMENT, SES PROPRIÉTAIRES OU TOUTE AUTRE PERSONNE. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST RESPONSABLE DES ERREURS, DES OMISSIONS OU DES INTERRUPTIONS D'UN INDICE MSCI OU EN RAPPORT AVEC CELUI-CI OU DE TOUTE INFORMATION QUI Y EST INCLUSE. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE FAIT, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, AUCUNE GARANTIE ET LES PARTIES MSCI DÉCLINENT EXPRESSÉMENT PAR LES PRÉSENTES TOUTES LES GARANTIES RELATIVES AUX INDICES MSCI ET À TOUTES LES DONNÉES QUI Y SONT INCLUSES QUANT À LEUR QUALITÉ MARCHANDE ET LEUR ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER. SANS POUR AUTANT LIMITER LE CARACTÈRE GÉNÉRAL DE CE QUI PRÉCÈDE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE SERA EN AUCUN CAS TENUE RESPONSABLE DES DOMMAGES DIRECTS, INDIRECTS, PARTICULIERS, DE NATURE PUNITIVE OU CONSÉCUTIFS OU DE TOUT AUTRE PRÉJUDICE (Y COMPRIS LE MANQUE À GAGNER), MÊME SI ELLES SONT AVISÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

Avertissement

Ce document est fourni à titre d'information seulement et il ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation ou une offre, un conseil ou une invitation d'achat ou de vente des parts ou actions des FCP, FCPE, SICAV, compartiment de SICAV, SPPIICAV présentés dans ce document (« les OPC ») et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. Ce document ne constitue pas la base d'un contrat ou d'un engagement de quelque nature que ce soit. Toutes les informations contenues dans ce document peuvent être modifiées sans préavis. La société de gestion n'accepte aucune responsabilité, directe ou indirecte, qui pourrait résulter de l'utilisation de toutes informations contenues dans ce document. La société de gestion ne peut en aucun cas être tenue responsable pour toute décision prise sur la base de ces informations. Les informations contenues dans ce document vous sont communiquées sur une base confidentielle et ne doivent être ni copiées, ni reproduites, ni modifiées, ni traduites, ni distribuées sans l'accord écrit préalable de la société de gestion, à aucune personne tierce ou dans aucun pays où cette distribution ou cette utilisation serait contraire aux dispositions légales et réglementaires ou imposerait à la société de gestion ou à ses fonds de se conformer aux obligations d'enregistrement auprès des autorités de tutelle de ces pays. Tous les OPC ne sont pas systématiquement enregistrés dans le pays de juridiction de tous les investisseurs. Investir implique des risques : les performances passées des OPC présentées dans ce document ainsi que les simulations réalisées sur la base de ces dernières, ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne préjugent pas des performances futures de ces derniers. 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. Les prospectus complets des OPC de droit français visés par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sont disponibles gratuitement sur simple demande au siège social de la société de gestion. Concernant les mandats de gestion, ce document fait partie du relevé des activités de gestion de votre portefeuille et doit être lu conjointement avec tout autre relevé périodique ou avis de confirmation relatif aux opérations de votre portefeuille, fourni par votre teneur de compte. La source des données du présent document est la société de gestion 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 décline 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.