

AMUNDI S&P 500 CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB UCITS ETF

Acc

ACTION ■

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **34,63 (USD)**
Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**
Actif géré : **3 968,06 (millions USD)**
Code ISIN : **IE00005FBC47**
Type de Réplication : **Physique**
Indice de référence :
**100% S&P 500 NET ZERO 2050 PARIS-ALIGNED
ESG+ INDEX**

Objectif d'investissement

Le Compartiment a pour objectif de répliquer la performance de l'Indice S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned 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 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 -	Depuis le 15/07/2020
Portefeuille	11,44%	3,03%	11,44%	32,44%	39,16%	-	73,13%
Indice	11,44%	3,03%	11,44%	32,47%	39,36%	-	73,66%
Ecart	0,01%	0,00%	0,01%	-0,03%	-0,21%	-	-0,53%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portefeuille	29,49%	-21,97%	-	-	-
Indice	29,54%	-21,95%	-	-	-
Ecart	-0,05%	-0,02%	-	-	-

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	12,29%	17,75%	17,77%
Volatilité de l'indice	12,29%	17,76%	17,78%
Tracking Error ex-post	0,04%	0,03%	0,03%
Ratio de sharpe	2,19	0,46	0,76

* 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.

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 S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG+ est un indice d'actions qui mesure la performance des titres de participation éligibles par rapport à l'Indice S&P 500 (l'« Indice parent ») sélectionné et pondéré pour être compatible collectivement avec un scénario de réchauffement climatique mondial de 1,5 °C. Il intègre un large éventail d'objectifs liés au climat couvrant le risque de transition, les opportunités liées au changement climatique et le risque physique. L'Indice parent est un indice d'actions représentatif des principaux titres négociés aux États-Unis.

Caractéristiques (Source : Amundi)

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

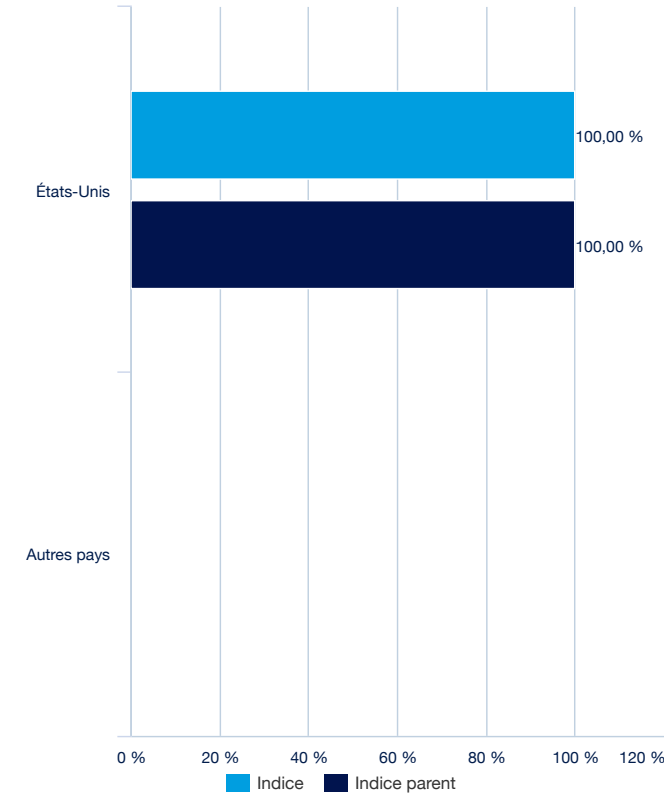
Nombre de valeurs : **345**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
MICROSOFT CORP	7,28%	7,09%
APPLE INC	6,01%	5,65%
NVIDIA CORP	4,96%	5,06%
AMAZON.COM INC	4,85%	3,74%
ALPHABET INC CL A	3,03%	2,02%
ALPHABET INC CL C	2,57%	1,70%
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,97%	2,42%
VISA INC-CLASS A SHARES	1,81%	1,00%
ELI LILLY & CO	1,72%	1,41%
MASTERCARD INC-CL A	1,56%	0,90%
Total	35,77%	31,00%

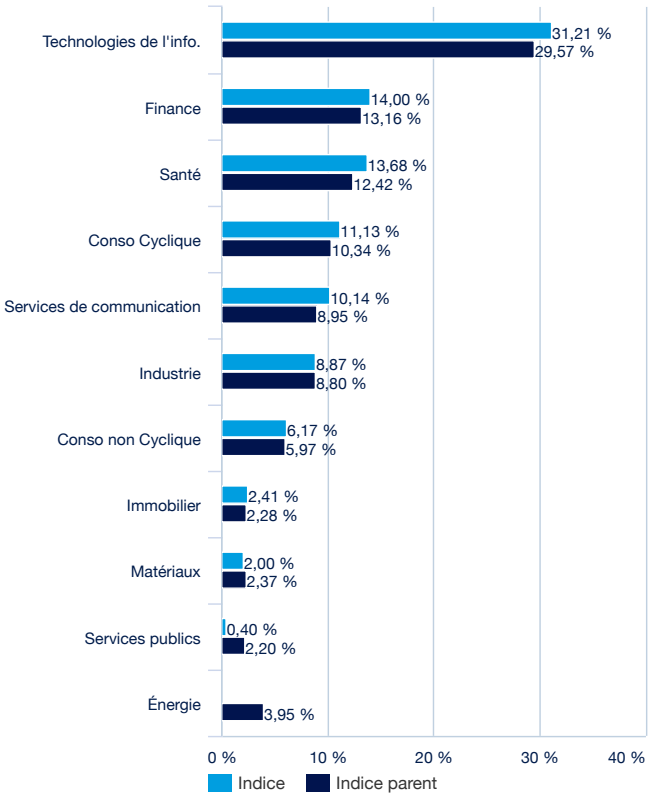
Indice parent : **S&P 500**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **S&P 500**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **S&P 500**

ACTION

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	6,84	6,69
Environnement	7,19	6,86
Social	5,09	5,13
Gouvernance	5,47	5,50

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)

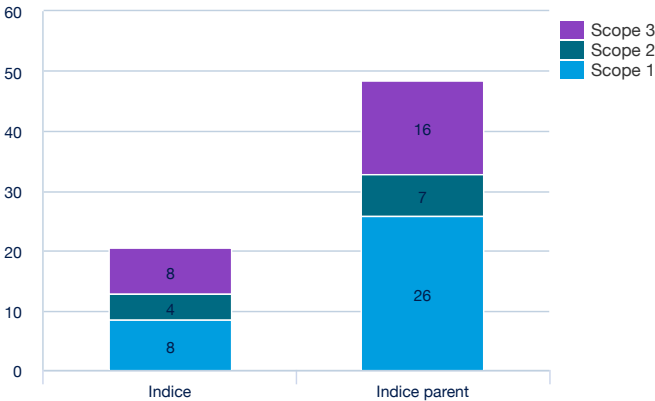
«G» pour Gouvernance (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

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) :	20,77	49,15



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





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	22/11/2023
Date de la première VL	15/07/2020
Devise de référence de la classe	USD
Classification AMF	-
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	IE000O5FBC47
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,07% (Estimés) - 22/11/2023
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	-	EUR	ZPA5	ZPA5 GY	ZPA5EUIV	ZPA5.DE	ZPA5EURINAV=SOLA
Deutsche Börse	-	USD	PABU	ZPA6 GY	PABUUSIV	ZPA5USD.DE	PABUUSDINAV=SOLA
Deutsche Börse	-	GBP	PABL	ZPA7 GY	PABLGBIV	ZPA5GBP.DE	PABLGBPINAV=SOLA
Borsa Italiana	-	EUR	PABUS	PABUS IM	ZPA5EUIV	PABUS.MI	ZPA5EURINAV=SOLA
Six Swiss Exchange	-	USD	PABU	PABU SW	PABUUSIV	PABU.S	PABUUSDINAV=SOLA
Nyse Euronext Paris	-	EUR	PABU	PABU FP	ZPA5EUIV	PABU.PA	ZPA5EURINAV=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 (Instiit)	+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

Le Compartiment n'est ni commandité, ni approuvé, ni vendu, ni recommandé par Standard & Poor's ou ses filiales (« S&P »). S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ni garantie, explicite ou implicite, aux actionnaires du Compartiment ou à tout membre du public concernant les opportunités d'investissement dans des valeurs mobilières en général ou dans un Compartiment particulier ou concernant la capacité du S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index à reproduire le rendement de certains marchés financiers et/ou de parties de ces marchés et/ou groupes ou catégories d'actifs. La seule relation liant S&P à Amundi Asset Management est l'octroi de licences pour certaines marques déposées ou marques commerciales et pour le S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index qui est défini, composé et calculé par S&P, sans considération pour Amundi Asset Management ou pour le Compartiment. S&P n'est pas tenue de tenir compte des besoins d'Amundi Asset Management ou des actionnaires du Compartiment lors de la définition de la composition ou du calcul du S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index. S&P n'est pas responsable et n'a pas été partie à la définition des prix et des montants du Compartiment ou au calendrier d'émission ou de vente des Compartiments ou à la définition ou au calcul de l'équation de conversion des actions des Compartiments en actifs liquides. S&P n'a aucune obligation ou responsabilité en termes d'administration ou de commercialisation du Compartiment.

S&P ne garantit pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité du S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index ou de toute donnée qu'il contient et décline toute responsabilité en cas d'erreur, d'omission ou d'interruption en découlant. S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ni garantie, explicite ou implicite, concernant les résultats qui seront obtenus par Amundi Asset Management, les actionnaires du Compartiment ou toute autre personne ou entité utilisant le S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index ou toute donnée qu'il contient. S&P ne fait aucune déclaration et ne fournit aucune condition ou garantie, explicite ou implicite, et refuse expressément toute garantie, condition de qualité du marché ou aptitude à une fin objective ou spécifique et toute autre garantie ou condition, explicite ou implicite, relative au S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index ou à toute donnée qu'il contient. Sans limiter ce qui précède, S&P ne sera pas responsable des dommages spéciaux, punitifs, indirects ou consécutifs (y compris la perte de profits) résultant de l'utilisation du S&P Europe LargeMidCap Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index ou de toute autre donnée qu'il contient, même si elle a été avertie de la possibilité que ledit dommage puisse survenir.

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, SPICAV 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 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.