

Amundi CAC 40 ESG UCITS ETF

ACTIONS ■

REPORTING

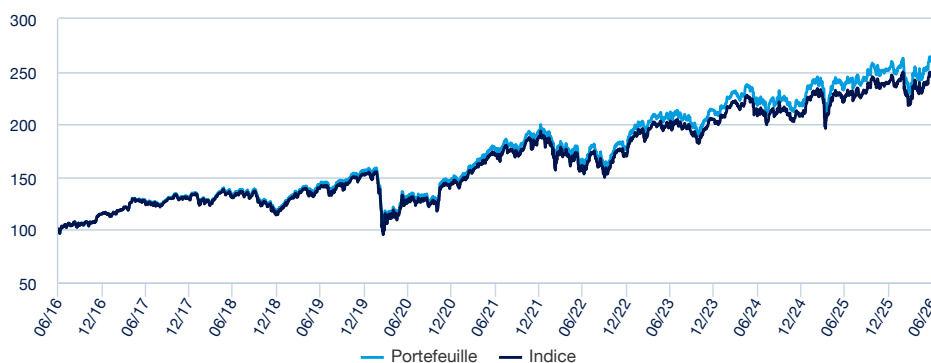
Communication
Publicitaire

30/06/2026

Objectif d'investissement

Ce Compartiment est géré passivement. L'objectif de ce Compartiment est de répliquer la performance de l'Indice CAC 40 ESG 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 net : les dividendes nets d'impôt payés par les composants de l'indice sont inclus dans le rendement de l'Indice. L'Indice est un indice d'actions basé sur le CAC 40, qui regroupe les 40 titres les plus importants et les plus activement négociés sur la Bourse de Paris (l'« Indice Parent »). L'Indice exclut certaines entreprises de l'Indice Parent sur la base de critères environnementaux, sociaux et de gouvernance, et vise une réduction minimale de 30 % de l'intensité des émissions de carbone par rapport à l'Indice Parent, ainsi qu'une amélioration de la note ESG et du ratio vert/brun. L'Indice applique des exclusions ciblant les sociétés impliquées dans des activités considérées comme non alignées sur l'Accord de Paris sur le climat (extraction de charbon, pétrole, etc.). Ces exclusions sont prévues à l'article 12, paragraphe 1, points a) à g), du règlement délégué (UE) 2020/1818 de la Commission du 17 juillet 2020 complétant le règlement (UE) 2016/1011 du Parlement européen et du Conseil par des normes minimales pour les indices de référence « transition climatique » de l'Union et les indices de référence « accord de Paris » de l'Union. Veuillez vous référer à la section « Directives concernant les dénominations des fonds contenant des termes liés aux critères ESG ou à la durabilité » du Prospectus. 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 inexacts. Même lorsque ces données sont identifiées, rien ne permet de garantir qu'elles seront correctement évaluées. De plus amples informations sur la composition de l'indice et ses règles de fonctionnement sont disponibles dans le prospectus et à l'adresse : euronext.com. La valeur de l'Indice est disponible via Bloomberg (CACESGRI). 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	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le
	31/12/2025	29/05/2026	31/03/2026	30/06/2025	30/06/2023	30/06/2021	30/06/2021	28/02/2003
Portefeuille	4,11%	4,26%	12,94%	10,65%	24,11%	49,70%	528,42%	
Indice	3,55%	4,18%	12,26%	10,08%	22,27%	45,99%	464,94%	
Ecart	0,56%	0,08%	0,68%	0,56%	1,84%	3,71%	63,48%	

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2025	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Portefeuille	14,60%	3,34%	21,17%	-9,08%	31,61%	-5,15%	30,19%	-8,21%	12,51%	8,63%
Indice	14,06%	2,82%	20,55%	-9,54%	31,07%	-5,57%	29,24%	-8,88%	11,69%	7,67%
Ecart	0,54%	0,51%	0,62%	0,46%	0,53%	0,42%	0,95%	0,67%	0,82%	0,96%

* 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 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.

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	16,10%	15,60%	19,92%
Volatilité de l'indice	16,10%	15,60%	19,93%
Tracking Error ex-post	0,25%	0,26%	0,26%
Ratio de sharpe	0,50	0,28	0,35

* 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" © : 4 étoiles

Catégorie Morningstar © :

EAA FUND FRANCE EQUITY

Date de notation : 31/05/2026

Nombre de fonds de la catégorie : 211

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.

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **(C) 149,26 (EUR)**
(D) 86,50 (EUR)

Date de VL et d'actif géré : **30/06/2026**

Actif géré : **820,46 (millions EUR)**

Code ISIN : **LU1681046931**

Type de Réplication : **Physique**

Indice de référence : **100% CAC 40 ESG**

Date du dernier coupon : **09/12/2025**

Derniers Coupons par part : **2,40 (EUR)**

Date de la première VL : **28/02/2003**

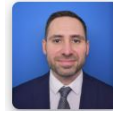
VL de lancement : -

ACTIONS ■

Rencontrez l'équipe

**Lionel Brafman**

Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie

**Isabelle Lafargue**Responsable Gestion Indicielle & Multistratégies –
Fonds Régionaux**Christophe Neves**

Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice CAC 40 ESG est un indice d'actions représentatif des 40 principales sociétés démontrant de solides pratiques environnementales, sociales et de gouvernance au sein de l'Indice CAC Large 60 (Indice cadre) représentant les 60 principaux titres négociés sur la Bourse de Paris. L'Indice vise à générer une empreinte carbone pondérée réduite et à améliorer le ratio vert/brun par rapport à son Indice cadre.

Caractéristiques (Source : Amundi)

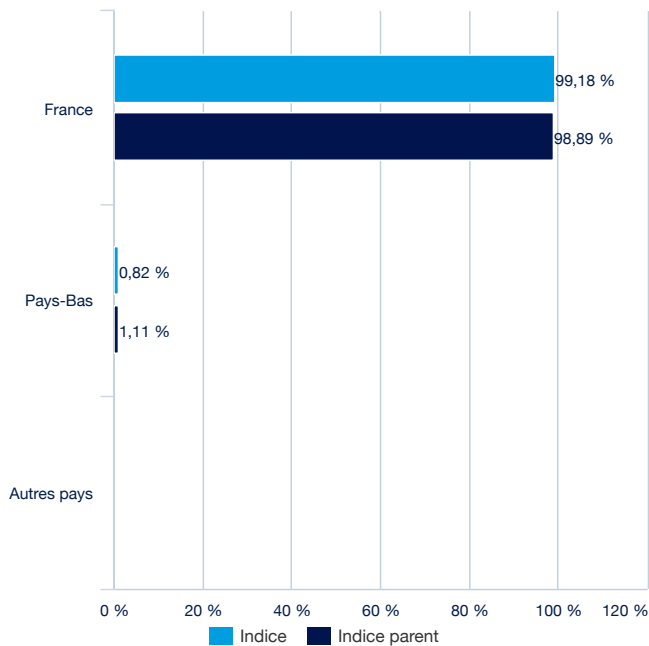
Classe d'actif : **Actions**Exposition : **Europe**Devise de référence de l'indice : **EUR**Nombre de valeurs : **39**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

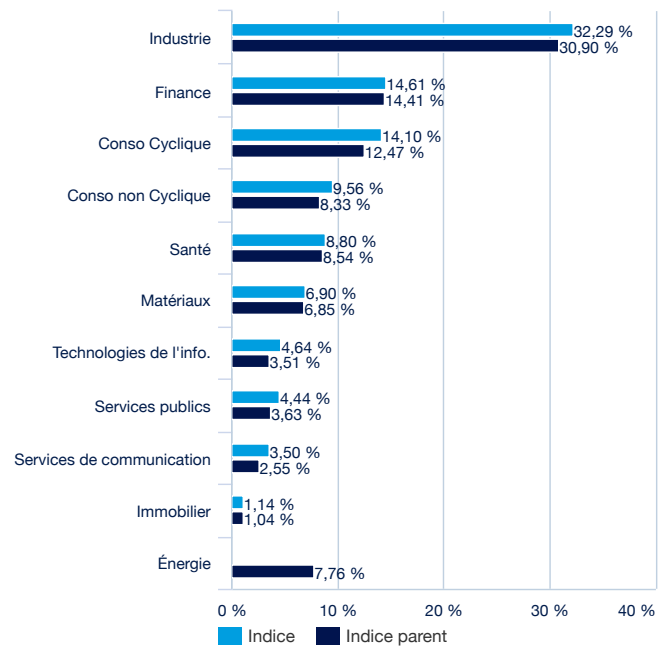
	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
SCHNEIDER ELECT SE	9,61%	8,15%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	6,96%	6,25%
AIRBUS SE PARIS	6,52%	5,78%
BNP PARIBAS	6,19%	5,47%
AIR LIQUIDE SA	6,09%	5,58%
SAFRAN SA	5,88%	5,43%
SANOFI - PARIS	5,50%	4,47%
L OREAL (PARIS)	5,46%	4,72%
AXA SA	4,54%	4,06%
VINCI SA (PARIS)	3,76%	3,38%
Total	60,52%	53,29%

Indice parent : **CAC LARGE 60**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)

Indice parent : **CAC LARGE 60**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)

Indice parent : **CAC LARGE 60**

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	7,31	7,32
Environnement	6,62	6,64
Social	4,77	4,95
Gouvernance	6,56	6,48

Indice parent : CAC LARGE 60

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)

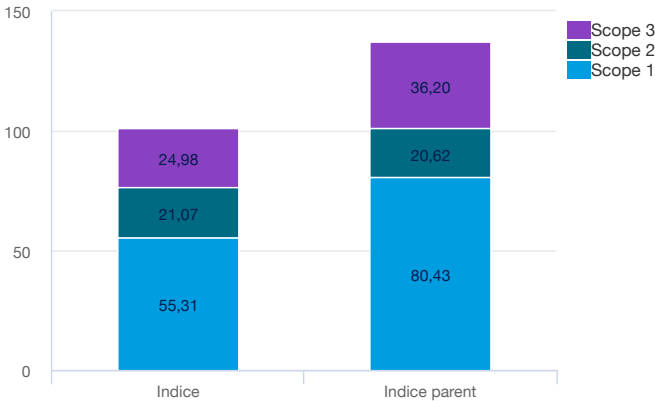
«G» pour Gouvernance (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

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) :	101,36	137,25



Indice parent : CAC LARGE 60

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 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.

ACTIONS ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Dépositaire	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Commissaire aux comptes	DELOITTE AUDIT
Date de création de la classe	14/02/2018
Date de la première VL	28/02/2003
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	-
Affectation des sommes distribuables	(C) Capitalisation (D) Distribution
Code ISIN	(C) LU1681046931 (D) LU1681047079
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	0,25%
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	Eligible au PEA
Clôture fiscale	Septembre
Teneur marché principal	BNP Paribas

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

Place de cotation	Devise	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Six Swiss Exchange	EUR	C40 SW	INC40	C40.S	INC40=BNPP
Deutsche Boerse (Xetra)	EUR	GC40 GY	INC40	GC40.DE	INC40=BNPP
Euronext Paris	EUR	C40 FP	INC40	C40.PA	INC40=BNPP
Bolsa Mexicana de Valores	MXN	C40N MM	-	-	-
Euronext Milan	EUR	C40 IM	INC40	C40.MI	INC40=BNPP

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-ett@amundi.com

ACTIONS ■

Fournisseurs d'indices

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, SPPICAV 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.