

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB - UCITS ETF DR - HEDGED GBP

ACTION ■

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **187,91 (GBP)**
Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**
Actif géré : **588,81 (millions GBP)**
Code ISIN : **LU1646359619**
Type de Réplication : **Physique**
Indice de référence :
**100% MSCI JAPAN SRI FILTERED PAB 100%
HEDGED TO GBP**

Objectif d'investissement

Le fonds a pour objectif de répliquer la performance de l'Indice MSCI Japan SRI Filtered PAB (l'« Indice ») et minimiser l'écart de suivi entre la valeur liquidative du compartiment et la performance de l'Indice. Le compartiment est un produit financier qui promeut, entre autres caractéristiques, des caractéristiques ESG en vertu de l'Article 8 du Règlement « Disclosure », comme décrit plus en détail dans l'Annexe 1 : Informations relatives aux critères ESG du Prospectus.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



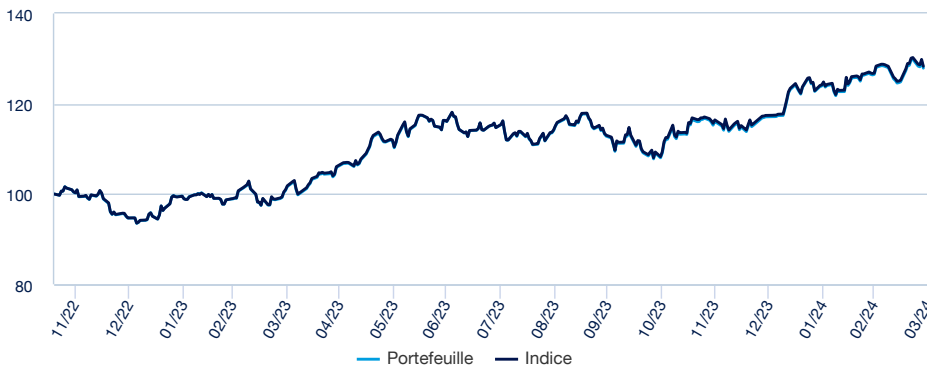
Risque le plus faible

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 -	5 ans -	Depuis le 18/11/2022
Portefeuille	9,22%	1,09%	9,22%	25,79%	-	-	27,89%
Indice	9,28%	1,20%	9,28%	26,00%	-	-	28,31%
Ecart	-0,06%	-0,11%	-0,06%	-0,21%	-	-	-0,42%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portefeuille	23,69%	-	-	-	-
Indice	23,99%	-	-	-	-
Ecart	-0,30%	-	-	-	-

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	14,00%	-	13,48%
Volatilité de l'indice	14,01%	-	13,48%
Tracking Error ex-post	0,30%	-	0,31%
Ratio de sharpe	1,49	-	1,12

* 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

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice MSCI Japan SRI Filtered PAB est un indice d'actions basé sur l'indice MSCI Japan, représentatif des titres de moyenne à grande capitalisation du marché japonais (l'« Indice cadre »). 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 répondre les titres en fonction des opportunités et des risques liés à la transition climatique afin de répondre aux exigences minimales de la réglementation de l'Union européenne sur les indices de référence « Accord de Paris » (EU PAB).

Caractéristiques (Source : Amundi)

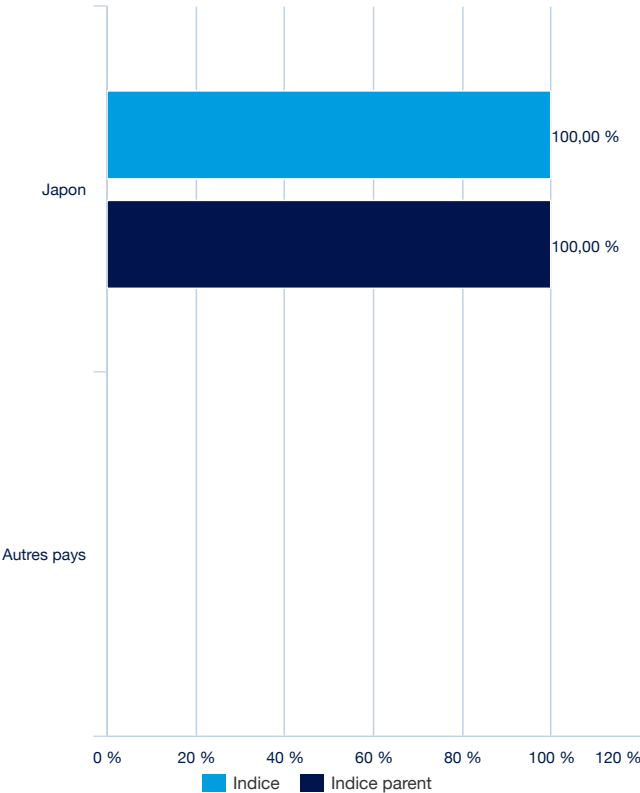
Classe d'actif : **Action**
Exposition : **Japon**
Devise de référence de l'indice : **JPY**
Nombre de valeurs : **47**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
HOYA CORP	5,08%	1,09%
SONY GROUP CORP (JT)	4,78%	2,72%
SUMITOMO MISUI FINAN	4,62%	1,88%
ADVANTEST	4,48%	0,87%
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	4,48%	1,41%
FANUC CORP	4,34%	0,66%
DAIKIN INDUSTRIES LTD	4,00%	0,90%
ORIENTAL LAND CO LTD	3,49%	0,88%
RENASAS ELECTRONICS CORP	3,47%	0,65%
KDDI CORP	3,45%	1,11%
Total	42,19%	12,16%

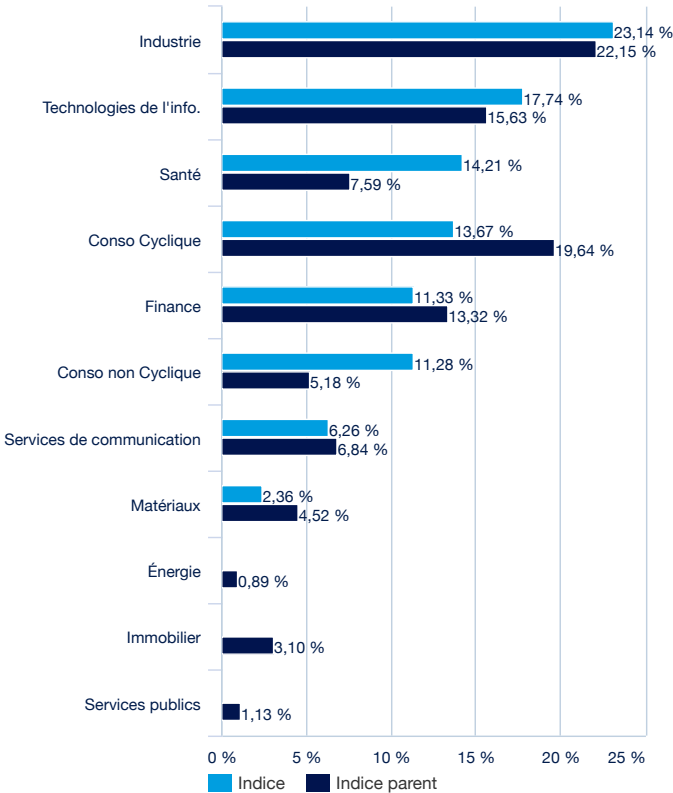
Indice parent : **MSCI JAPAN**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **MSCI JAPAN**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **MSCI JAPAN**

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	8,79	7,32
Environnement	6,94	6,14
Social	6,13	5,53
Gouvernance	6,07	5,60

Indice parent : MSCI JAPAN

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)

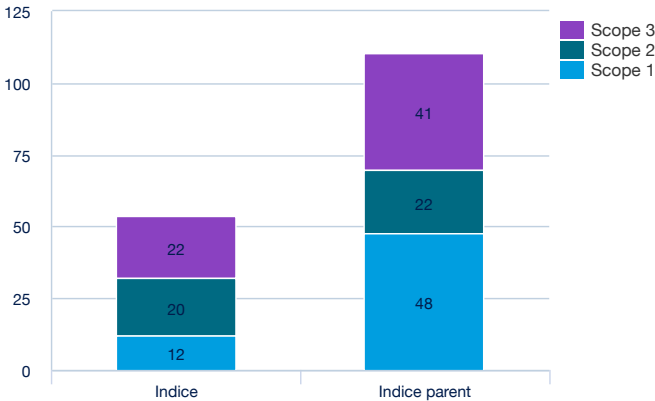
«G» pour Gouvernance (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

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) :	53,96	110,37



Indice parent : MSCI JAPAN

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



ACTION ■

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	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	18/11/2022
Date de la première VL	18/11/2022
Devise de référence de la classe	GBP
Classification AMF	-
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1646359619
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,20% (Estimés) - 31/10/2022
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	-
Clôture fiscale	Décembre
Teneur marché principal	BNP Paribas

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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	JPXX	JPXX LN	JPXXIV	JPXX.L	JPXXINAV=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 INDEX MSCI JAPAN SRI PAB (LE « COMPARTIMENT ») N'EST EN AUCUNE FAÇON SPONSORISÉ, AVALISÉ, VENDU OU PROMU PAR MSCI INC. (« MSCI »), NI PAR L'UNE DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, L'UN DE SES FOURNISSEURS D'INFORMATIONS OU AUCUN TIERS CONCERNÉ PAR LA COMPOSITION OU LA CRÉATION D'UN INDICE MSCI (COLLECTIVEMENT, LES « PARTIES MSCI »). LES INDICES MSCI SONT LA PROPRIÉTÉ EXCLUSIVE DE MSCI ET SONT DES MARQUES DE SERVICE DE MSCI OU DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES. LES INDICES MSCI ONT FAIT L'OBJET D'UNE LICENCE ACCORDÉE, POUR CERTAINS BESOINS, À AMUNDI. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE FAIT DE DÉCLARATION, NI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ÉMETTEUR OU AUX PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, OU À TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, CONCERNANT LA PERTINENCE D'INVESTIR DANS LES COMPARTIMENTS EN GÉNÉRAL OU DANS CE COMPARTIMENT EN PARTICULIER, OU LA CAPACITÉ DE TOUT INDICE MSCI À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DU MARCHÉ BOURSIER CORRESPONDANT. MSCI OU SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES SONT LES CONCÉDANTS DE LA LICENCE DE CERTAINES MARQUES DÉPOSÉES, MARQUES DE SERVICE ET NOMS COMMERCIAUX, AINSI QUE DES INDICES MSCI DÉTERMINÉS, COMPOSÉS ET CALCULÉS PAR MSCI, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI, DE CE COMPARTIMENT, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ.

AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST TENUE DE PRENDRE EN COMPTE LES BESOINS D'AMUNDI, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ DANS LE CADRE DE LA DÉFINITION, DE LA COMPOSITION OU DU CALCUL DES INDICES MSCI. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST RESPONSABLE DE LA DÉTERMINATION DE LA DATE DE LANCEMENT, DU PRIX OU DE LA QUANTITÉ DES ACTIONS DU COMPARTIMENT, NI DE LA DÉTERMINATION OU DU CALCUL DE LA FORMULE/DÉS CRITÈRES SELON LESQUELS, LE COMPARTIMENT EST REMBOURSABLE, AUTANT D'OPÉRATIONS AUXQUELLES AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A PRIS PART. PAR AILLEURS, AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A D'OBLIGATION OU DE RESPONSABILITÉ À L'ÉGARD DE L'ÉMETTEUR, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ RELATIVEMENT À L'ADMINISTRATION, À LA COMMERCIALISATION ET 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 QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, LA PRÉCISION ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI INDEX OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, LES RÉSULTATS DEVANT ÊTRE OBTENUS PAR L'ÉMETTEUR DU COMPARTIMENT, LES PORTEURS DE PARTS DE CE DERNIER OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, ET PROVENANT DE L'UTILISATION DE TOUT INDICE MSCI INDEX OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE PEUT ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION RELATIVES AUX INDICES MSCI INDEX OU À TOUTE DONNÉE Y FIGURANT. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE DONNE DE GARANTIE EXPRESSE OU IMPLICITE DE QUELQUE SORTIE QUE CE SOIT, ET LES PARTIES MSCI N'EXPRIMENT AUCUNE GARANTIE DE QUALITÉ MARCHANDE ET D'ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER EN CE QUI CONCERNE LES INDICES MSCI INDEX ET TOUTE DONNÉE Y FIGURANT. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE POURRA ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTS DOMMAGES DIRECTS, INDIRECTS, SPÉCIAUX, PUNITIFS, CONSÉCUTIFS OU AUTRES (Y COMPRIS UNE QUELCONQUE PERTE DE BÉNÉFICES), QUAND BIEN MÊME ELLE AURAIT ÉTÉ AVISÉE DE L'ÉVENTUALITÉ 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 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.