

# Amundi PEA S&P 500 ESG UCITS ETF - Acc

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/03/2024

ACTION ■

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **39,71 ( EUR )**  
Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**  
Actif géré : **999,46 ( millions EUR )**  
Code ISIN : **FR0013412285**  
Type de Réplication : **Synthétique**  
Indice de référence : **100% S&P 500 ESG+ INDEX**

## Objectif d'investissement

L'objectif de gestion du Fonds est de répliquer, le plus fidèlement possible, la performance en euro de l'Indice S&P 500 ESG+, quelle que soit son évolution, positive ou négative.

## 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)



A : A compter du 29/09/2023, le benchmark sera S&P 500 ESG+ Index

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

Depuis le	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le
	29/12/2023	29/02/2024	29/12/2023	31/03/2023	31/03/2021	-	25/04/2019
<b>Portefeuille</b>	12,58%	3,47%	12,58%	29,66%	48,97%	-	98,53%
<b>Indice</b>	12,73%	3,50%	12,73%	29,92%	48,57%	-	96,14%
<b>Ecart</b>	-0,15%	-0,04%	-0,15%	-0,26%	0,39%	-	2,39%

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

	2023	2022	2021	2020	2019
<b>Portefeuille</b>	21,53%	-12,95%	38,24%	8,54%	-
<b>Indice</b>	21,54%	-13,17%	37,89%	8,03%	-
<b>Ecart</b>	-0,01%	0,22%	0,35%	0,52%	-

\* 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.

### Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
<b>Volatilité du portefeuille</b>	10,77%	14,80%	17,69%
<b>Volatilité de l'indice</b>	10,78%	14,81%	17,69%
<b>Tracking Error ex-post</b>	0,06%	0,05%	0,05%
<b>Ratio de sharpe</b>	2,42	0,85	0,81

\* 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

## ACTION ■

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

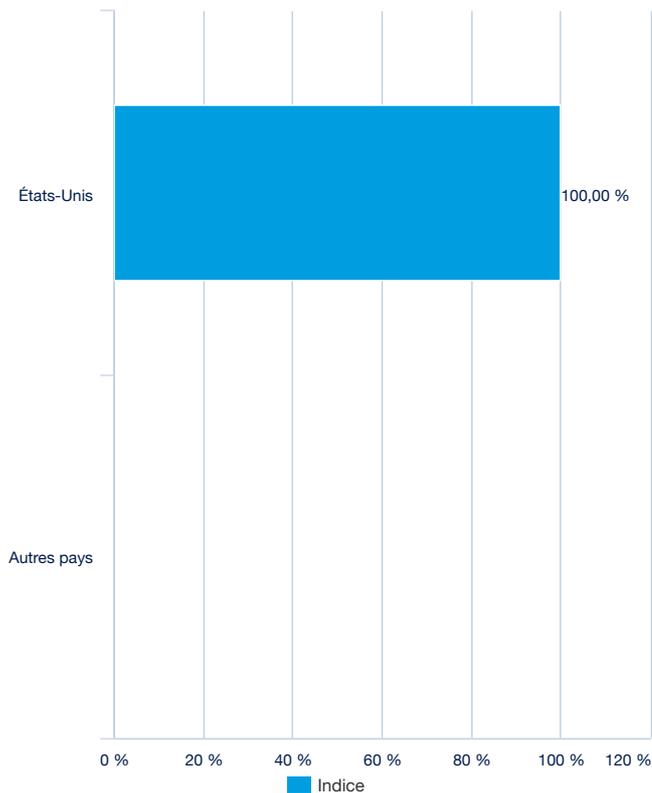
## Description de l'indice

L'indicateur de référence du Fonds est l'Indice S&P 500 ESG+, libellé en dollar américain, dividendes nets réinvestis (net return).  
L'Indice S&P 500 ESG+ est un indice « actions », calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux Standard & Poor's. (S&P).  
L'univers d'investissement initial est identique à celui de l'indice S&P 500 conçu pour mesurer la performance des 500 actions de large capitalisation boursière traitées aux États-Unis, tout en intégrant des critères environnementaux, sociaux et gouvernementaux (ESG).  
Pour plus d'informations sur la méthodologie de l'indicateur de référence, veuillez-vous référer au Prospectus du Fonds.

## Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Action**  
Exposition : **USA**  
Devise de référence de l'indice : **USD**  
Nombre de valeurs : **306**

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



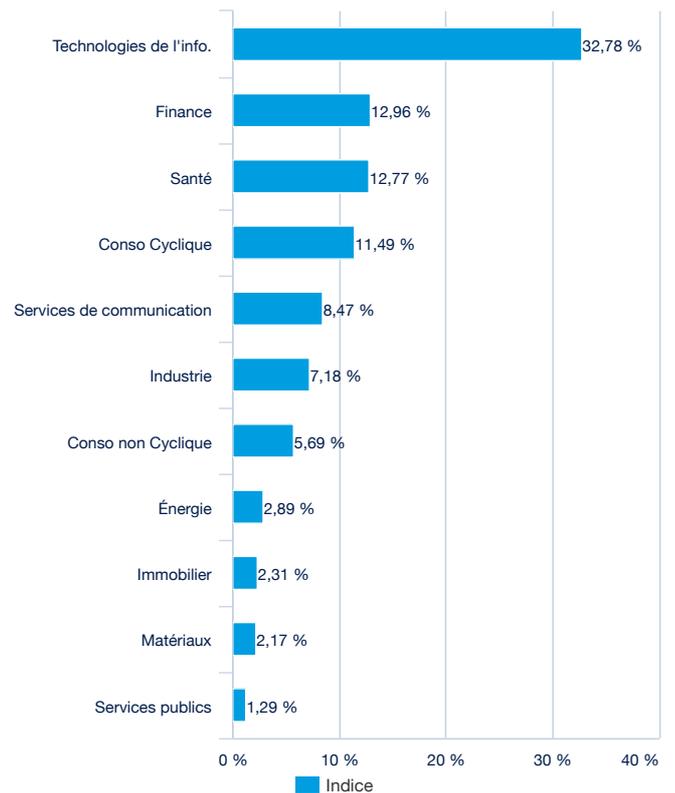
Indice parent :

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

	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
MICROSOFT CORP	9,61 %	-
APPLE INC	7,65 %	-
NVIDIA CORP	6,86 %	-
AMAZON.COM INC	5,07 %	-
ALPHABET INC CL A	2,73 %	-
ALPHABET INC CL C	2,31 %	-
ELI LILLY & CO	1,91 %	-
JPMORGAN CHASE & CO	1,78 %	-
TESLA INC	1,50 %	-
EXXON MOBIL CORP	1,42 %	-
<b>Total</b>	<b>40,84 %</b>	<b>-</b>

Indice parent :

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



Indice parent :

## 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	PTF	Critères ESG
<b>Note Globale</b>	6,99	7,69	Les critères sont des critères extra-financiers utilisés pour évaluer les pratiques environnementales, sociales et de gouvernance des entreprises.
<b>Environnement</b>	6,99	6,48	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 .
<b>Social</b>	5,32	5,99	
<b>Gouvernance</b>	5,44	6,03	

Indice parent :

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**

Total en tCO<sub>2</sub> / M€ (Indice/Indice parent) :

Indice parent : -  
Indice parent : 154,65

**Empreinte Carbone**

Cet indicateur mesure les émissions du portefeuille en tonnes de CO<sub>2</sub> équivalent par million d'euros investis.

Il est un indicateur des émissions induites par l'investissement dans ce portefeuille.

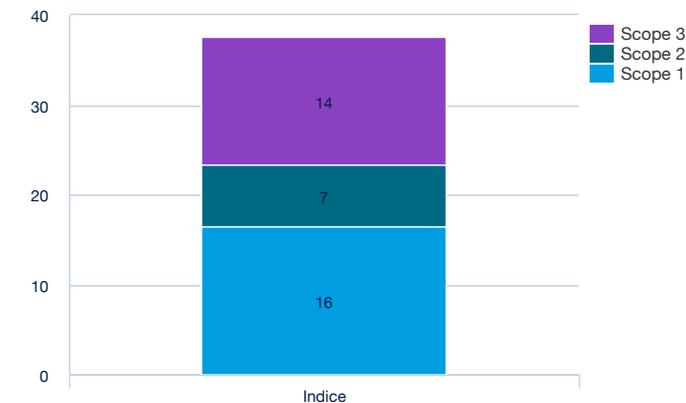
**Définition des scopes :**

- **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 carbonées sont fournies par Trucost. Elles correspondent aux émissions annuelles des entreprises et sont exprimées en tonnes équivalent CO<sub>2</sub>, 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 CO<sub>2</sub>.



Indice parent :

**Label ISR**

## ACTION ■

**Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)**

Forme juridique	Fonds Commun de Placement (FCP) de droit français
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Asset Management
Valorisateur	CACEIS Fund Administration France
Dépositaire	CACEIS Bank
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT
Date de création de la classe	25/04/2019
Date de la première VL	25/04/2019
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Actions internationales
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation et/ou Distribution
Code ISIN	FR0013412285
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,25% ( Estimés ) - 29/09/2023
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	Eligible au PEA
Clôture fiscale	Juin
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
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	EUR	PE500	PE500 FP	IP50E	PE500.PA	IP50EINAV.PA

**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 (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@amundiETF.com

## ACTION ■

## Fournisseurs d'indices

LE FONDS AMUNDI PEA S&P 500 ESG UCITS ETF N'EST PAS PARRAINE, SOUTENU, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES AFFILIES ("S&P"). S&P NE FAIT AUCUNE DECLARATION OU GARANTIE D'AUCUNE SORTE, EXPRESSE OU TACITE, AUX INVESTISSEURS OU A TOUT MEMBRE DU PUBLIC, QUANT A L'OPPORTUNITE D'INVESTIR DANS DES VALEURS QUELCONQUES OU DANS LE FONDS EN PARTICULIER, OU QUANT A LA CAPACITE DE L'INDICE S&P 500 ESG+ A TRACER LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHES FINANCIERS ET/OU SECTIONS DE CES MARCHES ET/OU GROUPES D'ACTIFS OU CLASSES D'ACTIFS. LE SEUL LIEN EXISTANT ENTRE S&P ET AMUNDI ASSET MANAGEMENT CONSISTE EN LA CONCESSION D'UNE LICENCE D'UTILISATION DE CERTAINES MARQUES ET NOMS COMMERCIAUX ET DE L'INDICE S&P 500 ESG+, QUI EST DETERMINE, COMPOSE ET CALCULE PAR S&P SANS CONSIDERATION D'AMUNDI ASSET MANAGEMENT OU DU FONDS. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRISE EN COMPTE DES BESOINS D'AMUNDI ASSET MANAGEMENT OU DES INVESTISSEURS AFIN DE DETERMINER, COMPOSER OU CALCULER L'INDICE S&P 500 ESG+. S&P N'ENCOURT AUCUNE RESPONSABILITE DU FAIT DE, ET N'A PAS PARTICIPE A, LA DETERMINATION DES PRIX ET DE LA VALEUR LIQUIDATIVE DU FONDS, NI A LA DETERMINATION DU MOMENT DE L'EMISSION OU DE LA VENTE DU FONDS, NI A LA DETERMINATION OU AU CALCUL DE LA FORMULE PERMETTANT LA CONVERSION DES PARTS DU FONDS EN ESPECES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITE EN LIEN AVEC L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA COTATION DU FONDS.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITE DE L'INDICE S&P 500 ESG+ OU DES DONNEES QUI Y SONT INCLUSES, ET N'ENCOURT AUCUNE RESPONSABILITE DU FAIT D'EVENTUELLES ERREURS, OMISSIONS OU INTERRUPTIONS. S&P NE FAIT AUCUNE GARANTIE OU DECLARATION, EXPRESSE OU TACITE, QUANT AUX RESULTATS OBTENUS PAR AMUNDI ASSET MANAGEMENT, LES INVESTISSEURS, OU PAR TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITE DU FAIT DE L'UTILISATION DE L'INDICE S&P 500 ESG+, OU DES DONNEES QUI Y SONT INCLUSES. S&P NE FAIT AUCUNE GARANTIE OU DECLARATION, EXPRESSE OU TACITE, ET SE DEGAGE EXPRESSEMENT DE TOUTE OBLIGATION DE GARANTIE DE LA QUALITE MARCHANDE OU DE LA CONFORMITE A TELLE DESTINATION OU TEL USAGE OU TOUTE AUTRE GARANTIE RELATIVEMENT A L'INDICE S&P 500 ESG+, OU AUX DONNEES QUI Y SONT INCLUSES. SANS PREJUDICE POUR CE QUI PRECEDE, S&P N'ENCOURRA AUCUNE RESPONSABILITE POUR LES EVENTUELS DOMMAGES SPECIAUX, PUNITIFS OU INDIRECTS (Y COMPRIS PERTES DE PROFITS) RESULTANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE S&P 500 ESG+ OU DES DONNEES QUI Y SONT INCLUSES, QUAND BIEN MEME S&P AURAIT ETE INFORME DE L'EVENTUALITE DE TELS DOMMAGES.

## Avertissement

Le fonds présente un risque de perte en capital non mesurable. Les performances passées ne préjugent en rien des résultats futurs et ne sont pas garantes des rendements à venir. Pour plus de détails concernant les risques et avant tout investissement, consultez le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (« DICI ») et le prospectus de ce fonds, disponibles en français sur simple demande ou sur le site [amundiETF.fr](http://amundiETF.fr). Les informations contenues dans ce document sont issues de sources considérées comme fiables. Amundi ne peut cependant en garantir l'exactitude et se réserve la possibilité de modifier à tout moment les analyses présentées ci-avant. Ce document non contractuel ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation d'offre, ou une offre d'achat, de vente portant sur le fonds mentionné, et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. La politique de transparence et des informations sur la composition des actifs des fonds sont disponibles sur [amundiETF.com](http://amundiETF.com). La valeur liquidative indicative est publiée par les bourses. Les parts des Fonds acquises sur le marché secondaire ne peuvent généralement pas être directement revendues au Fonds. Les investisseurs doivent acheter et vendre les parts sur un marché secondaire avec l'assistance d'un intermédiaire (par exemple un courtier) et peuvent ainsi supporter des frais. En outre, il est possible que les investisseurs paient davantage que la valeur liquidative actuelle lorsqu'ils achètent des parts et reçoivent moins que la valeur liquidative actuelle à la revente. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée sous la mention SYNTHÈSE DE GESTION en tête du document sauf mention contraire. Liste complète des brokers et market makers disponible sur : [amundiETF.com](http://amundiETF.com). Des frais d'intermédiaires financiers s'appliquent.

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 expressees 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.