

## AMUNDI ETF ICAV

Organisme irlandais de gestion collective d'actifs de type ouvert constitué sous la forme d'un fonds à compartiments à désolidarisation des engagements et au capital variable. L'ICAV a été enregistrée en vertu du droit irlandais sous le numéro C461194.

### SECOND ADDENDUM AU PROSPECTUS

1 mai 2025

Le présent Addendum contient des informations spécifiques relatives aux compartiments suivants d'Amundi ETF ICAV (l'ICAV) :

1. AMUNDI S&P GLOBAL COMMUNICATION SERVICES ESG UCITS ETF
2. AMUNDI S&P GLOBAL CONSUMER DISCRETIONARY ESG UCITS ETF
3. AMUNDI S&P GLOBAL CONSUMER STAPLES ESG UCITS ETF
4. AMUNDI S&P GLOBAL ENERGY CARBON REDUCED UCITS ETF
5. AMUNDI S&P GLOBAL FINANCIALS ESG UCITS ETF
6. AMUNDI S&P GLOBAL HEALTH CARE ESG UCITS ETF
7. AMUNDI S&P GLOBAL INDUSTRIALS ESG UCITS ETF
8. AMUNDI S&P GLOBAL INFORMATION TECHNOLOGY ESG UCITS ETF
9. AMUNDI S&P GLOBAL MATERIALS ESG UCITS ETF
10. AMUNDI S&P GLOBAL UTILITIES ESG UCITS ETF

(les **Compartiments**)

**Le présent Addendum est un supplément au prospectus de l'ICAV daté du 24 mars 2025 (le Prospectus), qui fait partie intégrante de ce dernier et doit être lu conjointement avec celui-ci.**

Les Administrateurs de l'ICAV dont les noms figurent à la section du Prospectus intitulée « Conseil d'administration de l'ICAV » assument la responsabilité des informations contenues dans le présent Addendum. À la connaissance des Administrateurs, qui ont pris toutes les précautions nécessaires pour s'en assurer, les informations contenues dans le présent document sont conformes à la réalité et ne comportent aucune omission de nature à en altérer la portée.

Les mots et expressions définis dans le Prospectus auront, sauf si le contexte exige une interprétation différente, la même signification lorsqu'ils sont utilisés dans le présent Addendum. À des fins d'interprétation en cas de conflit entre le présent Addendum et le Prospectus, ce conflit sera résolu en faveur du présent Addendum.

## **OBJET**

Le présent Addendum a pour objet de mettre à jour le Prospectus afin d'y inclure la description des Compartiments à la section intitulée « Description des Compartiments » et d'y apporter d'autres modifications.

# AMUNDI S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartment :** Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice :** The S&P World Communication Services Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promeut, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

- Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Communication Services Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services de communication de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de services de communication sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des services de communication se compose de sociétés qui facilitent la communication et proposent des contenus et des informations connexes par le biais de divers canaux. Il comprend les sociétés de télécommunications, de médias et de divertissement, y compris les producteurs de jeux interactifs et les sociétés engagées dans la création ou la distribution de contenu et d'informations par le biais de plateformes propriétaires. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicelles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent

- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/).

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPDSECUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacentes de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

## Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futures), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs à des valeurs mobilières et instruments monétaires, comme des contrats de prêts et d'emprunts de titres, et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplication pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de référence :** Euro

## Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

## Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions  
Change  
Fonds d'investissement  
Gestion  
Instruments dérivés  
Liquidité du marché coté  
Risque de concentration  
Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)  
Risque de marché  
Risques ESG

### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Contrepartie  
Liquidité  
Opérationnel  
Pratiques standard

## Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

## Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

## Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL : Jour d'opération + 1**

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Catégorie d'Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Frais annuels	
					Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

## Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES

# AMUNDI S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartment** : Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : The S&P World Consumer Discretionary Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promeut, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

- Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Consumer Discretionary Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de consommation discrétionnaire de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de biens de consommation discrétionnaire sont identifiées par référence au GICS. Le segment manufacturier du secteur des biens de consommation discrétionnaire comprend l'automobile, les biens ménagers durables, les équipements de loisirs et le textile et l'habillement. Le segment des services comprend les hôtels, les restaurants et autres installations récréatives, la production et les services médiatiques, ainsi que la vente au détail et les services aux consommateurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclus ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'Indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPSEDUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacentes de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

### Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au

marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futurs), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs à des valeurs mobilières et instruments monétaires, comme des contrats de prêts et d'emprunts de titres, et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplication pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de base :** Euro

### Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

## Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions  
Change  
Fonds d'investissement  
Gestion  
Instruments dérivés  
Liquidité du marché coté  
Risque de concentration  
Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)  
Risque de marché  
Risques ESG

### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Liquidité  
Opérationnel  
Pratiques standard  
Risque de contrepartie

### Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

## Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

## Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL : Jour d'opération + 1**

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

					Frais annuels	
Catégorie d'Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

## Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES

# AMUNDI S&P WORLD CONSUMER STAPLES SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartment** : Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : The S&P World Consumer Staples Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promeut, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

- Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Consumer Staples Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de consommation de base de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de biens de consommation de base sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des biens de consommation de base comprend les fabricants et les distributeurs d'aliments, de boissons et de tabac, ainsi que les producteurs de biens ménagers non durables et de produits personnels. Il comprend également des détaillants d'aliments et de médicaments ainsi que des hypermarchés et des supercentres de consommateurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumineux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent.
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'Indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPDSUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacentes de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

## Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futurs), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs aux valeurs mobilières et aux instruments du marché monétaire, tels que des prêts et emprunts de titres

et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplcation pour les Compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de référence :** Euro

### Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

## Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions

Change

Fonds d'investissement

Gestion

Instruments dérivés

Liquidité du marché coté

Risque de concentration

Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)

Risque de marché

Risques ESG

### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Liquidité

Opérationnel

Pratiques standard

Risque de contrepartie

### Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

## Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme

- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

## Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL : Jour d'opération + 1**

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

					Frais annuels	
Catégorie d'Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

## Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD CONSUMER STAPLES SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES.

# AMUNDI S&P WORLD ENERGY SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartment** : Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : S&P World Energy Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promeut, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

#### • Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Energy Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés d'énergie de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les compagnies énergétiques sont identifiées par référence au GICS. Le secteur de l'énergie comprend des sociétés engagées dans l'exploration et la production, le raffinage et la commercialisation, le stockage et le transport de pétrole et de gaz, ainsi que de charbon et de combustibles consommables. Il comprend également des sociétés qui proposent du matériel et des services pétroliers et gaziers. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPDSEEUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacentes de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

### Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futures), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment

peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs à des valeurs mobilières et instruments monétaires, comme des contrats de prêts et d'emprunts de titres, et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplication pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de référence :** Euro

#### Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

### Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

#### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions  
Change  
Fonds d'investissement  
Gestion  
Instruments dérivés  
Liquidité du marché coté  
Risque de concentration  
Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)  
Risque de marché  
Risques ESG

#### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Liquidité  
Opérationnel  
Pratiques standard  
Risque de contrepartie

#### Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

### Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

### Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL : Jour d'opération + 1**

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Catégorie d'Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Frais annuels	
					Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

## Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD ENERGY SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES.

# AMUNDI S&P WORLD FINANCIALS SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartiment** : Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : S&P World Financials Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promet, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

#### • Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Financials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services financiers de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés financières sont identifiées par référence au GICS. Le secteur financier regroupe des sociétés actives dans les domaines de la banque, de l'épargne et de la finance hypothécaire, de la finance spécialisée, de la finance aux particuliers, de la gestion d'actifs et des banques dépositaires, de la banque d'investissement, du courtage et des assurances. Il comprend également les données et échanges financiers, ainsi que les REIT hypothécaires. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indiciaires sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est SPDFUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacentes de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

### Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

### Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futures), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises

dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs à des valeurs mobilières et instruments monétaires, comme des contrats de prêts et d'emprunts de titres, et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplique pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de base :** Euro

### Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

## Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions  
Change  
Fonds d'investissement  
Gestion  
Instruments dérivés  
Liquidité du marché coté  
Risque de concentration  
Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)  
Risque de marché  
Risques ESG

### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Liquidité  
Opérationnel  
Pratiques standard  
Risque de contrepartie

### Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

## Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

## Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL :** Jour d'opération + 1

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Catégorie d'Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Frais annuels	
					Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

## Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD FINANCIALS SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES.

# AMUNDI S&P WORLD HEALTH CARE SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartment** : Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : The S&P World Health Care Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promet, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

- Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Health Care Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés du secteur de la santé de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de soins de santé sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des soins de santé comprend les prestataires et les services de soins de santé, les entreprises qui fabriquent et distribuent des équipements et des fournitures de soins de santé, ainsi que les sociétés de technologie de soins de santé. Il inclut également les sociétés impliquées dans la recherche, le développement, la production et la commercialisation de produits pharmaceutiques et biotechnologiques. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'Indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPDSEHUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'Indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacents de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

### Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futurs), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises

dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs à des valeurs mobilières et instruments monétaires, comme des contrats de prêts et d'emprunts de titres, et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplique pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de référence :** Euro

#### Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

## Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

#### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions  
Change  
Fonds d'investissement  
Gestion  
Instruments dérivés  
Liquidité du marché coté  
Risque de concentration  
Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)  
Risque de marché  
Risques ESG

#### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Liquidité  
Opérationnel  
Pratiques standard  
Risque de contrepartie

#### Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

## Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

## Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le Lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL : Jour d'opération + 1**

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Catégorie d'Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Frais annuels	
					Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

## Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD HEALTH CARE SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES.

# AMUNDI S&P WORLD INDUSTRIALS SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartment** : Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : S&P World Industrials Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promet, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

- Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Industrials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés industrielles de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés industrielles sont identifiées par référence au GICS. Le secteur industriel comprend les fabricants et les distributeurs de biens d'équipement tels que l'aérospatiale et la défense, les produits de construction, les équipements et machines électriques et les entreprises qui proposent des services de construction et d'ingénierie. Il comprend également les fournisseurs de services commerciaux et professionnels, y compris les services d'impression, environnementaux et d'installations, les services et fournitures de bureau, les services de sécurité et d'alarme, les services de ressources humaines et d'emploi, les services de recherche et de conseil. Il inclut également les sociétés qui proposent des services de transport. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclus ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclus ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPDSEIUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacentes de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxonomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

### Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futurs), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises dans

l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs à des valeurs mobilières et instruments monétaires, comme des contrats de prêts et d'emprunts de titres, et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplique pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de base :** Euro

### **Gestionnaire de placements**

Amundi Asset Management

## Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

### **Risques dans des conditions de marché ordinaires**

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions  
Change  
Fonds d'investissement  
Gestion  
Instruments dérivés  
Liquidité du marché coté  
Risque de concentration  
Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)  
Risque de marché  
Risques ESG

### **Risques liés à des conditions de marché inhabituelles**

Liquidité  
Opérationnel  
Pratiques standard  
Risque de contrepartie

### **Exposition globale et méthodologie de calcul**

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

## Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

## Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL : Jour d'opération + 1**

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Catégorie d'Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Frais annuels	
					Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

### Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD INDUSTRIALS SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES.

# AMUNDI S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartment** : Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : The S&P World Information Technology Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promet, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

- Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Information Technology Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de technologies de l'information de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés des technologies de l'information sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des technologies de l'information comprend les sociétés qui proposent des logiciels et des services de technologie de l'information, les fabricants et les distributeurs de matériel et d'équipements technologiques tels que les équipements de communication, les téléphones portables, les ordinateurs, les équipements électroniques et les semi-conducteurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclus ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](https://www.spglobal.com/spdji/)

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPDSETUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacentes de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détient aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce

Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

#### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

#### Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futurs), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs à des valeurs mobilières et instruments monétaires, comme des contrats de prêts et d'emprunts de titres, et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplcation pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de référence :** Euro

#### Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

### Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

#### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions  
Change  
Fonds d'investissement  
Gestion  
Instruments dérivés  
Liquidité du marché coté  
Risque de concentration  
Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)  
Risque de marché  
Risques ESG

#### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Liquidité  
Opérationnel  
Pratiques standard  
Risque de contrepartie

#### Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

### Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

### Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL :** Jour d'opération + 1

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Catégorie d' Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Frais annuels	
					Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

### Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSIION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES.

# AMUNDI S&P WORLD MATERIALS SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartiment** : Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : The S&P World Materials Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promeut, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

- Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Materials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de matériaux de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de matériaux sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des matériaux comprend les sociétés qui fabriquent des produits chimiques, des matériaux de construction, du verre, du papier, des produits forestiers et des produits d'emballage connexes, ainsi que les sociétés métallurgiques, de minéraux et minières, y compris les producteurs d'acier. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicelles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'Indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPDSEMUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'Indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacentes de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

## Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futurs), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs aux valeurs mobilières et aux instruments du marché monétaire, tels que des prêts et emprunts de titres

et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplication pour les Compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de base :** Euro

### Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

## Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions

Change

Fonds d'investissement

Gestion

Instruments dérivés

Liquidité du marché coté

Risque de concentration

Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)

Risque de marché

Risques ESG

### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Liquidité

Opérationnel

Pratiques standard

Risque de contrepartie

### Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

## Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

## Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL : Jour d'opération + 1**

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

Catégorie d'Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Frais annuels	
					Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

## Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD MATERIALS SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES.

# AMUNDI S&P WORLD UTILITIES SCREENED UCITS ETF

## Objectif et politique d'investissement

**Compartment** : Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF (le « Compartiment »)

**Indice** : The S&P World Utilities Weighted & Screened Index (l'« Indice »)

Le Compartiment est un produit financier qui promet, entre autres, les caractéristiques ESG conformes à l'Article 8 du Règlement sur la publication d'informations.

Des informations sur la cohérence entre l'Indice et les caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance sont disponibles sous « Description de l'Indice ».

### Objectif d'investissement

Répliquer la performance de l'Indice.

### Description de l'Indice

- Description générale de l'Indice

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Utilities Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services publics de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de services publics sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des services publics comprend des sociétés de services publics tels que l'électricité, le gaz et l'eau. Il comprend également des producteurs d'électricité indépendants et des négociants en énergie, ainsi que des sociétés qui s'engagent dans la production et la distribution d'électricité à partir de sources renouvelables. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indiciaires sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- Devise de l'Indice : Dollar des États-Unis
- Composition de l'Indice

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent

- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note ESG S&P Global, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](https://www.spglobal.com/spdji/).

- Mise à jour de l'Indice

Le rééquilibrage de l'Indice est planifié trimestriellement.

- Publication de l'Indice

L'Indice est calculé et publié par Standard & Poor's (« S&P »).

L'Indice est calculé quotidiennement par S&P sur la base des prix de clôture officiels des places boursières sur lesquelles les composantes de l'indice sont négociées.

La valeur de l'Indice est disponible sur Bloomberg. À la date du prospectus, le ticker correspondant est : SPSEUUN.

La performance répliquée est celle du cours de clôture de l'Indice.

La méthodologie de l'indice S&P, sa composition, les règles de rééquilibrage et un complément d'information sur les composantes sous-jacents de l'Indice sont disponibles sur <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>

## Processus de gestion

Le Compartiment est géré selon une approche passive et 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 décrits plus en détail ci-dessous et représentant les composantes de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice, comme décrit plus en détail à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus. À l'exception des investissements autorisés dans des options de gré à gré, des instruments financiers dérivés sur swaps (décrits plus en détail à la section « Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés » ci-dessous) et des liquidités, le Compartiment investira dans des actions et des Instruments liés à des actions cotés et négociés sur des Marchés réglementés. Afin de reproduire l'Indice, le Compartiment peut investir jusqu'à 20 % de sa Valeur liquidative dans des actions émises par la même entité. Cette limite peut être portée à 35 % pour un même émetteur lorsque des conditions de marché exceptionnelles s'appliquent (par exemple, lorsque la pondération de l'émetteur dans l'Indice est relevée en raison de sa position dominante sur le marché ou à la suite d'une fusion).

Le Compartiment intègre des risques de durabilité et tient compte des principaux impacts négatifs des investissements sur les facteurs de durabilité dans son processus d'investissement, comme indiqué plus en détail à la section « Investissement durable » de ce Prospectus. Il ne détiendra aucun titre de sociétés impliquées dans la production ou la vente d'armes controversées, ni de sociétés qui enfreignent les conventions internationales sur les droits de l'Homme ou le droit du travail, ou de sociétés impliquées dans des industries controversées, comme le tabac, le charbon thermique, les armes nucléaires ou le pétrole et le gaz non conventionnels, comme expliqué à la section « Méthodes de réplification pour les compartiments gérés passivement ». Vous trouverez de plus amples informations sur le Règlement Taxinomie et ce Compartiment à la section « Investissements durables » du Prospectus. D'autres informations relatives à l'application du Règlement sur la publication d'informations sont présentées à l'Annexe 1 – Publications liées aux informations ESG.

### Erreur de suivi

L'erreur de suivi mesure la volatilité de la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice. Dans des conditions normales de marché, il est prévu que le Compartiment

reproduise la performance de l'Indice avec une erreur de suivi pouvant aller jusqu'à 1 %.

### Techniques et instruments ayant pour objet des titres et instruments dérivés

Afin de faire face aux flux entrants et sortants, ainsi qu'à certaines spécificités des marchés d'actions locaux (y compris d'accès au marché, de liquidité ou de fiscalité locale), le Gestionnaire de placements peut investir dans des contrats à terme (futures), des options et des swaps qui se rapportent à des actions comprises dans l'Indice ou qui sont autrement conformes à l'Objectif d'investissement du Compartiment. Dans ce cas, le Compartiment peut détenir des dépôts tout en maintenant la totalité de son exposition à l'Indice.

Le Compartiment peut recourir à des techniques et instruments d'optimisation de gestion de portefeuille relatifs à des valeurs mobilières et instruments monétaires, comme des contrats de prêts et d'emprunts de titres, et des contrats de prise et de mise en pension, comme décrit dans les sections « Techniques et instruments d'opérations de financement sur titres » et « Méthodes de réplcation pour les compartiments gérés passivement » de ce Prospectus, auxquelles il se conformera. Ces techniques et instruments peuvent notamment être utilisés pour générer un revenu supplémentaire pour le Compartiment.

Les proportions maximales et attendues des actifs du compartiment pouvant être soumis à des OFT sont indiquées dans le tableau intitulé « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de total return swaps ».

**Devise de référence :** Euro

### Gestionnaire de placements

Amundi Asset Management

## Principaux risques

Voir la section « Descriptions des risques » pour plus d'informations.

### Risques dans des conditions de marché ordinaires

Le Compartiment peut avoir une volatilité élevée en raison de son exposition aux marchés d'actions.

Actions  
Change  
Fonds d'investissement  
Gestion  
Instruments dérivés  
Liquidité du marché coté  
Risque de concentration  
Risque de couverture (Catégorie d'actions couvertes)  
Risque de marché  
Risques ESG

### Risques liés à des conditions de marché inhabituelles

Liquidité  
Opérationnel  
Pratiques standard  
Risque de contrepartie

### Exposition globale et méthodologie de calcul

Voir « Exposition globale et effet de levier » pour plus d'informations

## Profil de l'investisseur type

Le Compartiment a été conçu pour les investisseurs qui comprennent les risques du Compartiment et prévoient d'investir pendant au moins cinq ans. Le Compartiment s'adresse aux investisseurs qui :

- sont intéressés par une croissance de leur investissement à long terme
- cherchent à répliquer la performance de l'Indice tout en acceptant les risques et la volatilité qui y sont associés

## Détails de l'opération

**Jour ouvrable** Chaque jour de la semaine autre que le Jour de l'An, le Vendredi saint, le lundi de Pâques, le 1er mai (Jour du Travail), le Jour de Noël et le 26 décembre (ou tout autre jour déterminé au besoin par les Administrateurs sous réserve d'en avoir préalablement informé les Actionnaires).

**Jour d'opération** Chaque Jour ouvrable sera un Jour d'opération. À l'exception des Jours ouvrables où le Gestionnaire de placements détermine, à son entière discrétion, qu'en raison de la fermeture des marchés sur lesquels sont cotés ou négociés les investissements du Compartiment ou de celle des marchés pertinents pour l'Indice, une partie importante de l'Indice ne peut pas être négociée. Les jours de l'année en cours qui ne sont pas des Jours d'opération sont annoncés sur <https://www.amundi.ie>. En cas de besoin, les Administrateurs peuvent décider qu'un ou plusieurs de ces jours seront des Jours d'opération, après en avoir préalablement informé tous les Actionnaires.

**Heure limite d'opération** 18 h 30 (HNEC) le Jour ouvrable précédant le Jour d'opération pertinent.

**Point d'évaluation** Clôture du dernier marché pertinent chaque Jour d'opération.

**Date de règlement** Les fonds de souscription et les titres doivent être reçus dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant. Le règlement des produits de rachat ou des titres sera normalement effectué dans les deux Jours ouvrables suivant le Jour d'opération correspondant.

**Jour de publication de la VL : Jour d'opération + 1**

## PRINCIPALES CATÉGORIES D' ACTIONS ET COMMISSIONS

					Frais annuels	
Catégorie d' Actions	Change	Politique de dividendes (C) / (D)	Montant minimum de souscription*	Montant minimum de rachat*	Gestion (max.)	Administration (max.)
UCITS ETF Acc	EUR	(C)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100 000 USD	100 000 USD	0,08 %	0,10 %

\* Ces minimums sont appliqués en USD ou dans un montant équivalent dans la devise de la catégorie d'actions pertinente

### Avis de non-responsabilité du fournisseur d'indices

AMUNDI S&P WORLD UTILITIES SCREENED UCITS ETF N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES FILIALES (« S&P »). S&P NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION SUR, NE CONDITIONNE PAS ET NE GARANTIT PAS, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUX PROPRIÉTAIRES DU COMPARTIMENT OU AU PUBLIC, L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES TITRES DE MANIÈRE GÉNÉRALE OU PLUS PARTICULIÈREMENT DANS LE COMPARTIMENT, NI LA CAPACITÉ DU S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX À REPRODUIRE LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU PARTIES DE CEUX-CI ET/OU DE GROUPES D'ACTIFS OU DE CLASSES D'ACTIFS. LA SEULE RELATION DE S&P AVEC AMUNDI EST LA CONCESSION DE LICENCES DE CERTAINES MARQUES ET APPELLATIONS COMMERCIALES ET DU S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX, QUI EST DÉTERMINÉ, COMPOSÉ ET CALCULÉ PAR S&P, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI OU DU COMPARTIMENT. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION DE PRENDRE EN CONSIDÉRATION LES BESOINS D'AMUNDI OU D'INVESTISSEURS POUR DÉTERMINER, COMPOSER OU CALCULER LE S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P N'EST PAS RESPONSABLE ET N'A PAS PARTICIPÉ À LA DÉTERMINATION DES PRIX ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, AU CALENDRIER D'ÉMISSION, À LA VENTE DU COMPARTIMENT OU À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION PAR LAQUELLE LES ACTIONS DU COMPARTIMENT SONT CONVERTIES EN ESPÈCES. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DU S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX NI DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE SAURAIT ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'ERREURS, D'OMISSIONS OU D'INTERRUPTIONS DE L'INDICE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE CONDITIONNE PAS ET NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS PAR AMUNDI, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, EN UTILISANT LE S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. S&P NE DONNE, DE MANIÈRE EXPRESSE OU IMPLICITE, AUCUNE GARANTIE, NE FAIT AUCUNE DÉCLARATION, NE CONDITIONNE PAS ET DÉCLINE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE OU CONDITION DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UNE FIN OU UN USAGE PARTICULIERS, AINSI QUE TOUTE AUTRE GARANTIE OU CONDITION EXPRESSE OU IMPLICITE CONCERNANT LE S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE. SANS LIMITER CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE D'UN DOMMAGE PARTICULIER, PUNITIF, INDIRECT OU CONSÉCUTIF (PERTE DE BÉNÉFICES INCLUSE) RÉSULTANT DE L'UTILISATION DU S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE, MÊME SI ELLE A ÉTÉ INFORMÉE DE LA POSSIBILITÉ DE CES DOMMAGES.

Modèle d'informations précontractuelles pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, paragraphe 1, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit :

Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :

213800MUCC8T65PPGV54

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_ %



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 10 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Communication Services Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World

Communication Services Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement.
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

**Les indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● **Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie.

*La base de données des notes ESG S&P Global contient une note ESG totale au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.*

*Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.*

*Les filtres suivants sont ensuite appliqués :*

- 1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumineux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;*
- 2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;*
- 3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;*
- 4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;*
- 5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note ESG S&P Global se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.*

*Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :*

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent*
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.*

*\* Pour de plus amples informations sur la note ESG S&P Global, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur <https://www.spglobal.com/spdji/> [www.spglobal.com/spdji/](https://www.spglobal.com/spdji/)*

- **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier décile du secteur).

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de personnel, au

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de Principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



### **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) <https://about.amundi.com/esg-documentation>

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Communication Services Weighted & Screened Index (l'« Indice »).

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Communication Services Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services de communication de grande et moyenne capitalisation sur les « Marchés développés » (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de services de communication sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des services de communication se compose de sociétés qui facilitent la communication et proposent des contenus et des informations connexes par le biais de divers canaux. Il comprend les sociétés de télécommunications, de médias et de divertissement, y compris les producteurs de jeux interactifs et les sociétés engagées dans la création ou la distribution de contenu et d'informations par le biais de plateformes propriétaires. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

**la stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial du S&P World Communication Services Weighted & Screened Index comprend tous les titres qui constituent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note ESG S&P Global se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note ESG S&P Global, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 10 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

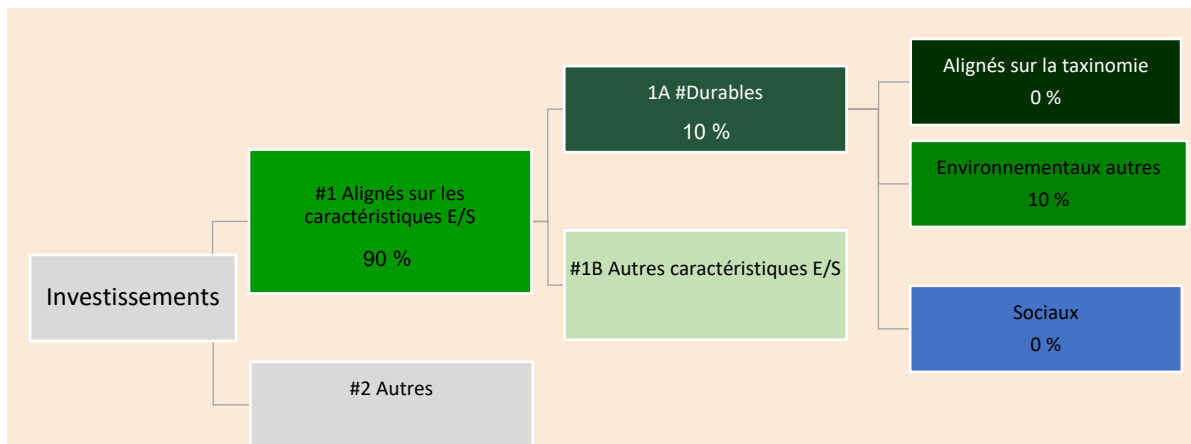
10 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>1</sup> ?**

Oui :

Dans le gaz fossile

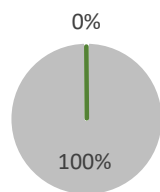
Dans l'énergie nucléaire

Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

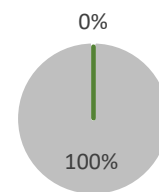
**Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.**

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines\*



■ Alignés sur la taxinomie (dont gaz fossile et nucléaire)  
■ Non-alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, autres que les obligations souveraines\*



■ Alignés sur la taxinomie (dont gaz fossile et nucléaire)  
■ Non-alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100 % des investissements totaux.

\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le Fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>1</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 10 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 10 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Communication Services Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services de communication de grande et moyenne capitalisation sur les Marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de services de communication sont identifiées par référence au GICS. Le

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

secteur des services de communication se compose de sociétés qui facilitent la communication et proposent des contenus et des informations connexes par le biais de divers canaux. Il comprend les sociétés de télécommunications, de médias et de divertissement, y compris les producteurs de jeux interactifs et les sociétés engagées dans la création ou la distribution de contenu et d'informations par le biais de plateformes propriétaires. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



- **Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**Vous trouverez de plus amples informations spécifiques au produit sur le site :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Dénomination du produit :

Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :

213800QD7NI9LMMJ8D95

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



x

Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_%



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 15 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**.

Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Consumer Discretionary Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en

appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Consumer Discretionary Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

**Les indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● ***Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?***

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie. La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de

décile du secteur).

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de Principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les

sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



## **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu https://about.amundi.com/esg-documentation](https://about.amundi.com/esg-documentation)

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Consumer Discretionary Weighted & Screened Index (l'« Indice »).

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Consumer Discretionary Index (l'« Indice parent »).

L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de consommation discrétionnaire de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de biens de consommation discrétionnaire sont identifiées par référence au GICS. Le segment manufacturier du secteur des biens de consommation discrétionnaire comprend l'automobile, les biens ménagers durables, les équipements de loisirs et le textile et l'habillement. Le segment des services comprend les hôtels, les restaurants et autres installations récréatives, la production et les services médiatiques, ainsi que la vente au détail et les services aux consommateurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

**La stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumineux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;

5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)  
La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

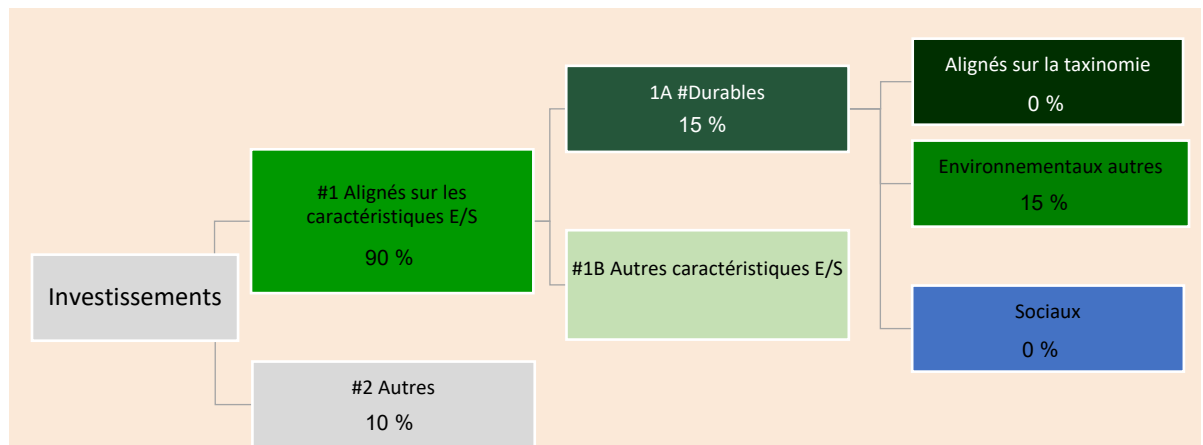
En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 15 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## **Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

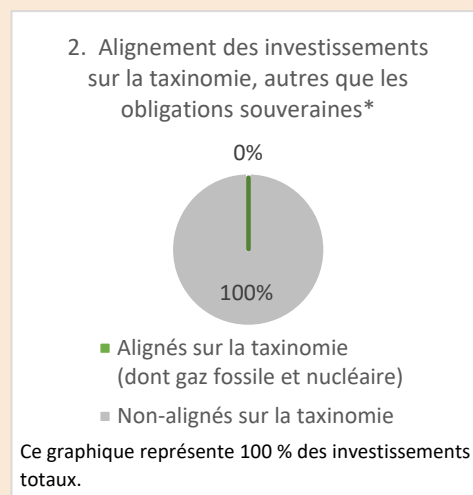
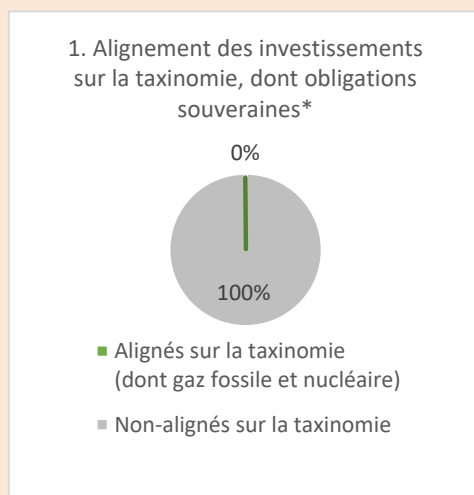
Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>2</sup> ?**

- Oui :
- Dans le gaz fossile                       Dans l'énergie nucléaire
- Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

**Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.**



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le Fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>2</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 15 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 15 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Consumer Discretionary Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de consommation discrétionnaire de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de biens de consommation discrétionnaire sont identifiées par référence

au GICS. Le segment manufacturier du secteur des biens de consommation discrétionnaire comprend l'automobile, les biens ménagers durables, les équipements de loisirs et le textile et l'habillement. Le segment des services comprend les hôtels, les restaurants et autres installations récréatives, la production et les services médiatiques, ainsi que la vente au détail et les services aux consommateurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

● **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



**Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Dénomination du produit :

Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :

213800OSD9FSVIM73191

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_%



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 15 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par investissement durable, on entend

un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE

est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Consumer Staples Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation

environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Consumer Staples Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement.

- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales en intégrant une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »).

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement.

- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

**Les indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● ***Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?***

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie. La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;

2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;

3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;

4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;

5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

● ***Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?***

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier décile du secteur).

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de Principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

- *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

- Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



### **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux

catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) <https://about.amundi.com/esg-documentation>

Non



### Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Consumer Staples Weighted & Screened Index (l'« Indice »).

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Consumer Staples Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de consommation de base de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de biens de consommation de base sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des biens de consommation de base comprend les fabricants et les distributeurs d'aliments, de boissons et de tabac, ainsi que les producteurs de biens ménagers non durables et de produits personnels. Il comprend également des détaillants d'aliments et de médicaments ainsi que des hypermarchés et des supercentres de consommateurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

**la stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

#### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;

3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;

4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;

5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent

- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

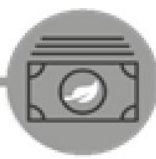
Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice. En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 15 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

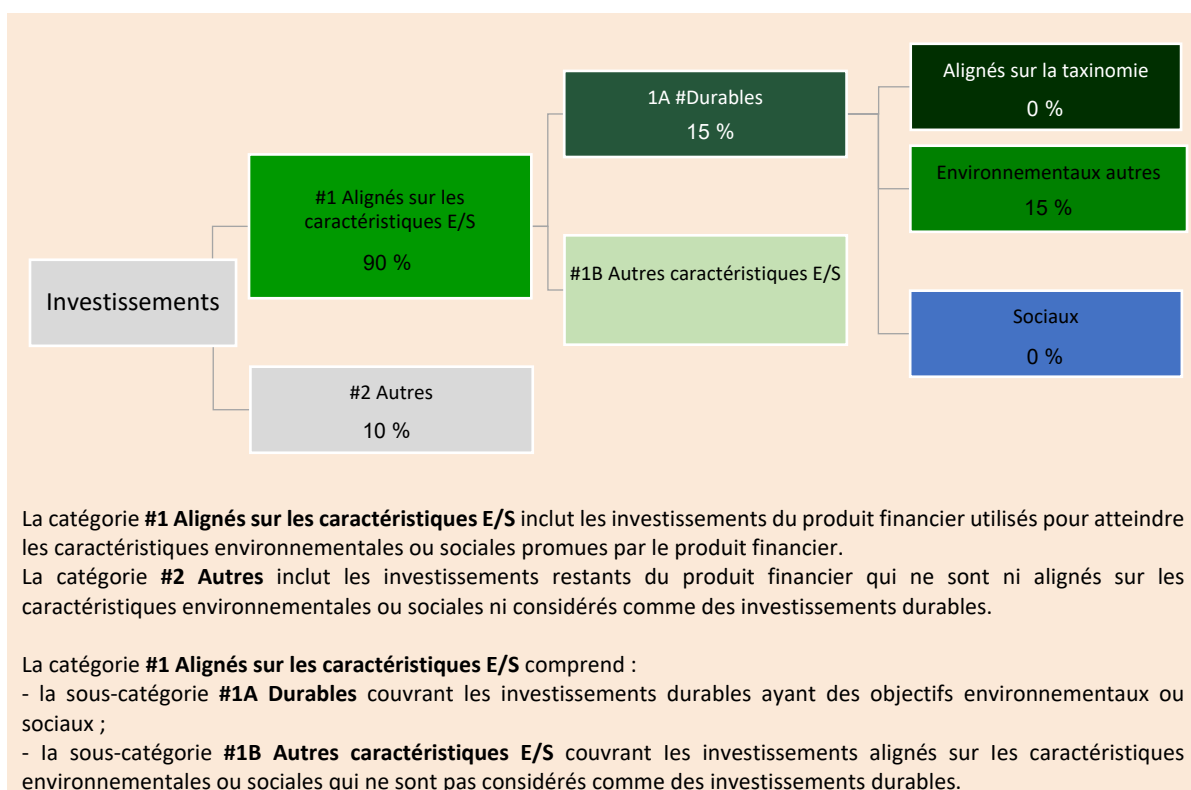
L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>3</sup> ?**

Oui :

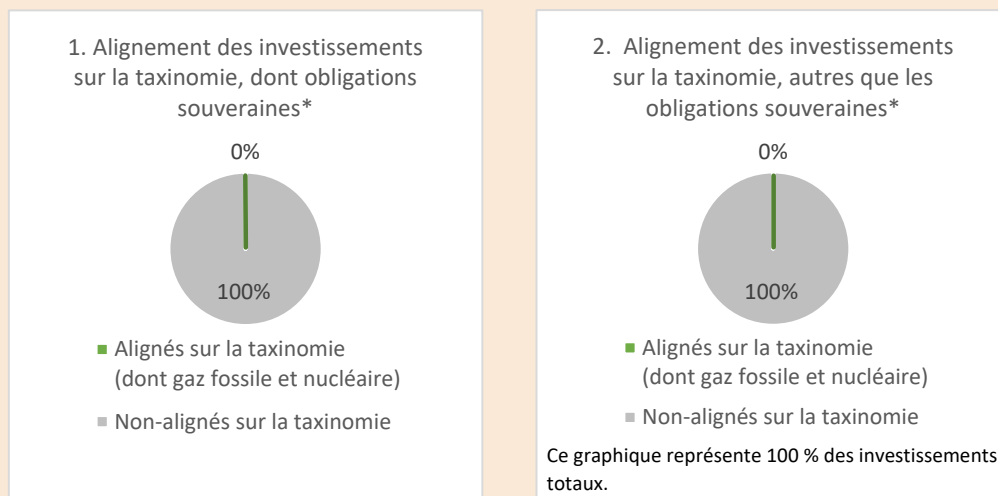
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

**Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.**



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>3</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 15 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 15 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Consumer Staples Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de consommation de base de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de biens de consommation de base sont identifiées par référence au GICS. Le

secteur des biens de consommation de base comprend les fabricants et les distributeurs d'aliments, de boissons et de tabac, ainsi que les producteurs de biens ménagers non durables et de produits personnels. Il comprend également des détaillants d'aliments et de médicaments ainsi que des hypermarchés et des supercentres de consommateurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent. L'Indice est un indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôts payés par les composantes indicielles sont inclus dans le rendement de l'Indice.

- **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



- **Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Dénomination du produit :  
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :  
2138006GH96S2Y7QT243

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_ %



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de \_\_\_ 0 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Energy Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en appliquant une série de

filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Energy Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● **Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie.

La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/).

- **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier décile du secteur).

**Les principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de personnel, au

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de Principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes

évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



### **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence

négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu](https://www.amundi.lu) <https://about.amundi.com/esg-documentation>

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Energy Weighted & Screened Index (l'« **Indice** »).

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Energy Index (l'« **Indice parent** »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés d'énergie de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les compagnies énergétiques sont identifiées par référence au GICS. Le secteur de l'énergie comprend des sociétés engagées dans l'exploration et la production, le raffinage et la commercialisation, le stockage et le transport de pétrole et de gaz, ainsi que de charbon et de combustibles consommables. Il comprend également des sociétés qui proposent des équipements et des services pour l'industrie pétrolière et gazière. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

**La stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note ESG S&P Global se concentre sur des critères de durabilité

financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/).

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

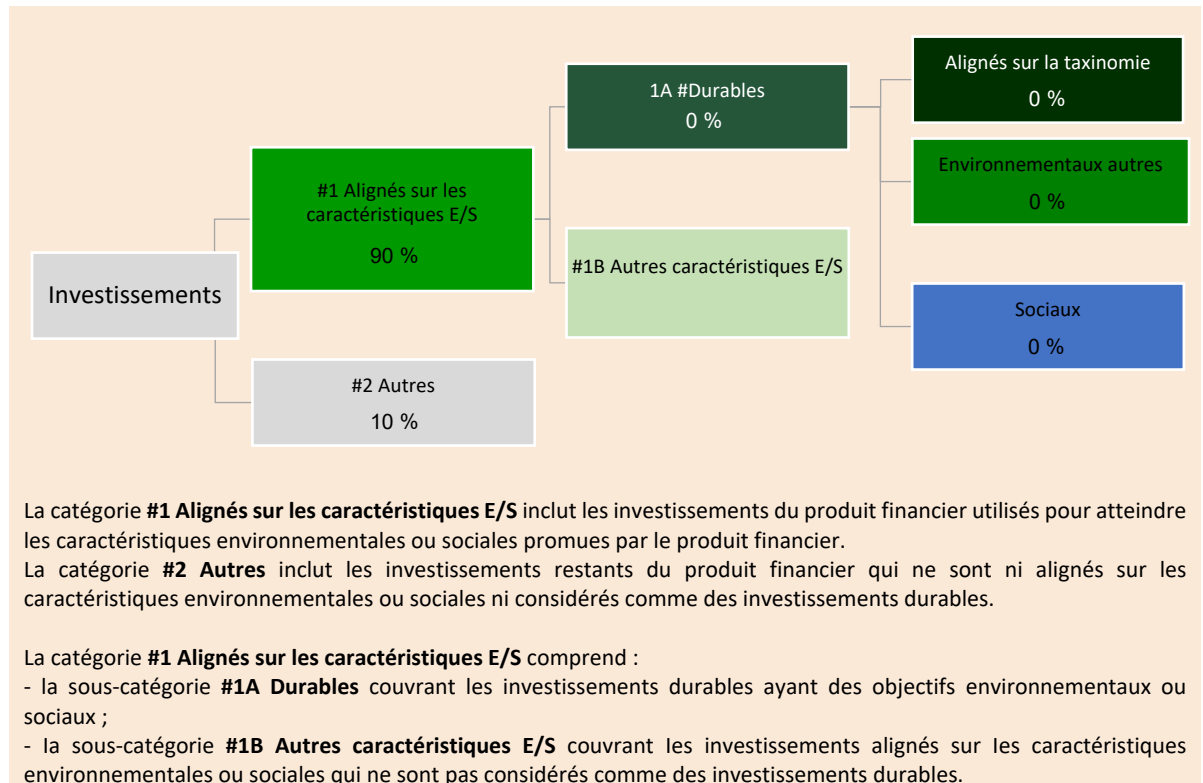
En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 0 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>4</sup> ?**

Oui :

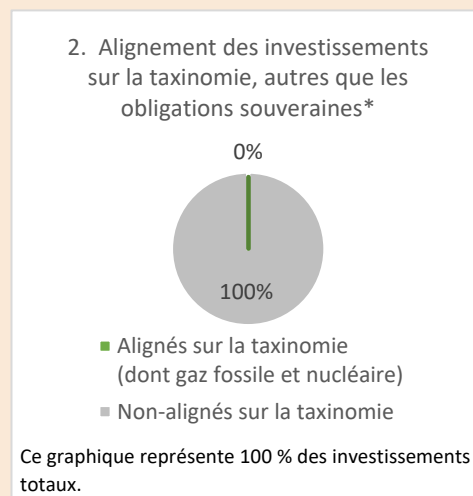
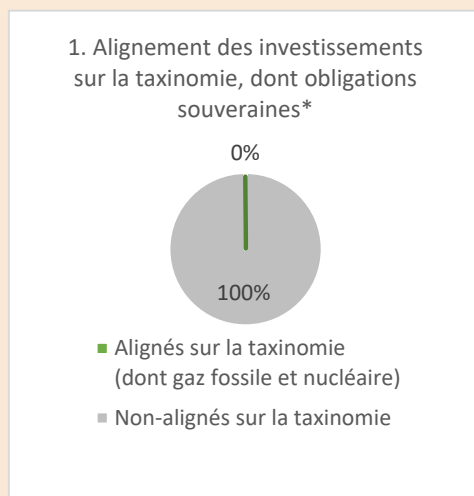
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le Fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>4</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif social.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Energy Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés d'énergie de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les compagnies énergétiques sont identifiées par référence au GICS. Le secteur de l'énergie comprend des sociétés

engagées dans l'exploration et la production, le raffinage et la commercialisation, le stockage et le transport de pétrole et de gaz, ainsi que de charbon et de combustibles consommables. Il comprend également des sociétés qui proposent des équipements et des services pour l'industrie pétrolière et gazière. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

● **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



**Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**Vous trouverez de plus amples informations spécifiques au produit sur le site :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundieftf.com](http://www.amundieftf.com).

Dénomination du produit :  
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :  
213800MIUWZSPFK4LM72

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_%



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de \_\_\_ 1 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Financials Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en

appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Financials Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement.
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

**Les indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● ***Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?***

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie. La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/).

- **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier

**Les principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de

décile du secteur).

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de Principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les

sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



## **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

**X** Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence

négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu](https://www.amundi.lu) <https://about.amundi.com/esg-documentation>

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Financials Weighted & Screened Index (l'« Indice »).

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Financials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services financiers de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés financières sont identifiées par référence au GICS. Le secteur financier regroupe des sociétés actives dans les domaines de la banque, de l'épargne et de la finance hypothécaire, de la finance spécialisée, de la finance aux particuliers, de la gestion d'actifs et des banques dépositaires, de la banque d'investissement, du courtage et des assurances. Il comprend également les données et échanges financiers, ainsi que les REIT hypothécaires. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

**La stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note ESG S&P Global se concentre sur des critères de durabilité

financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/).

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

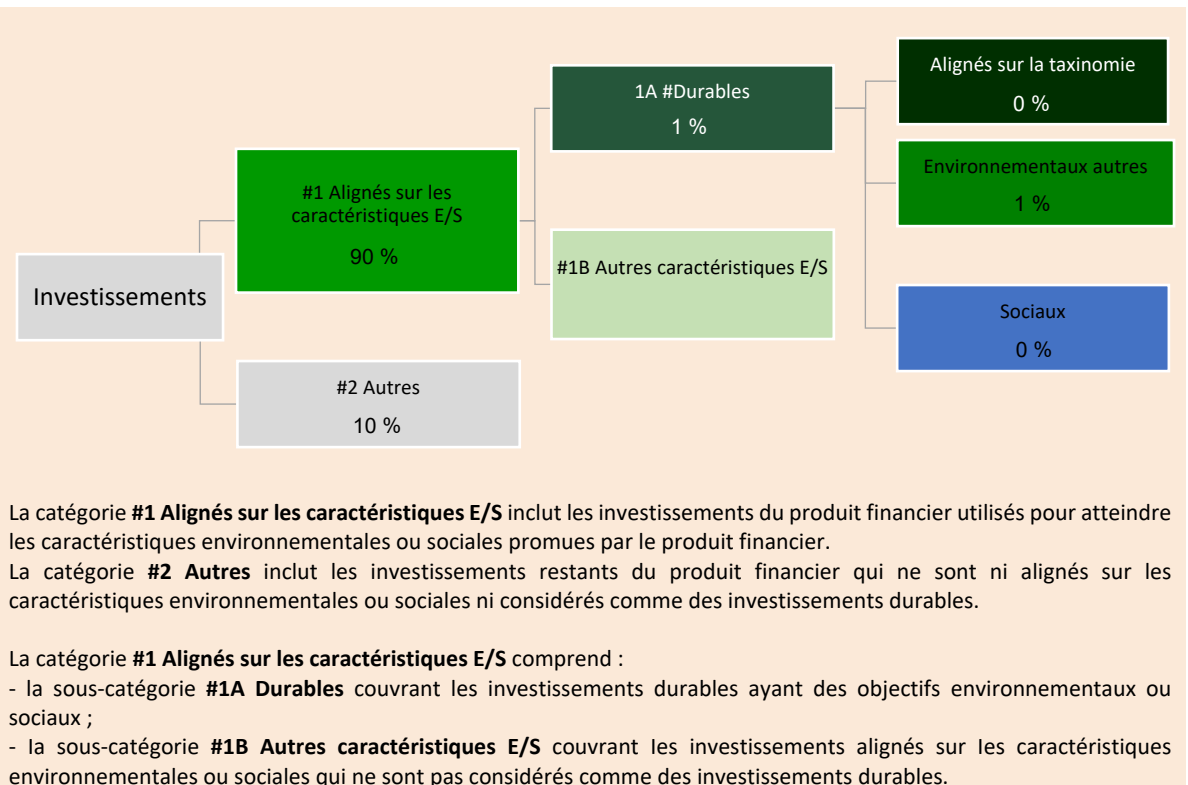
En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 1 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>5</sup> ?**

Oui :

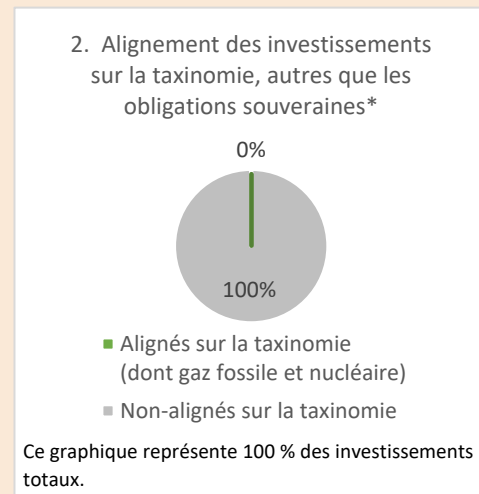
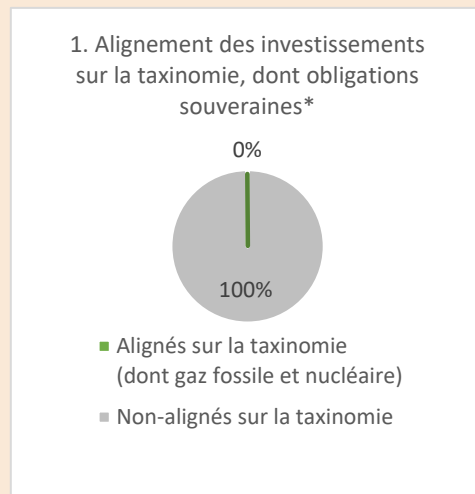
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>5</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne nuisent pas de manière significative à un objectif de la taxinomie de l'UE. Les critères complets pour les activités économiques de gaz fossile et d'énergie nucléaire conformes à la Taxinomie de l'UE sont définis dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 1 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 1 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Financials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services financiers de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés financières sont identifiées par référence au GICS. Le secteur financier regroupe des sociétés actives

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

dans les domaines de la banque, de l'épargne et de la finance hypothécaire, de la finance spécialisée, de la finance aux particuliers, de la gestion d'actifs et des banques dépositaires, de la banque d'investissement, du courtage et des assurances. Il comprend également les données et échanges financiers, ainsi que les REIT hypothécaires. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

● **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



**Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Dénomination du produit :  
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :  
213800SNXMHGMQYREZ20

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_%



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 25 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Health Care Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Health

Care Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des sociétés les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera globalement positive.
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera globalement inclinée négativement.

**Les indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● **Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie. La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier décile du secteur).

**Les principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de personnel, au respect des droits

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle a un critère dédié appelé « Implication dans la communauté et droits de l'homme » qui est appliqué à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, nous effectuons un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, ce qui inclut les entreprises identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



### **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories<sup>o</sup>: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) <https://about.amundi.com/esg-documentation>

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Health Care Weighted & Screened Index (l'« Indice »).

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Health Care Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés du secteur de la santé de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de soins de santé sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des soins de santé comprend les prestataires et les services de soins de santé, les entreprises qui fabriquent et distribuent des équipements et des fournitures de soins de santé, ainsi que les sociétés de technologie de soins de santé. Il inclut également les sociétés impliquées dans la recherche, le développement, la production et la commercialisation de produits pharmaceutiques et biotechnologiques. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

**La stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent. Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note ESG S&P Global se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note ESG S&P Global, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

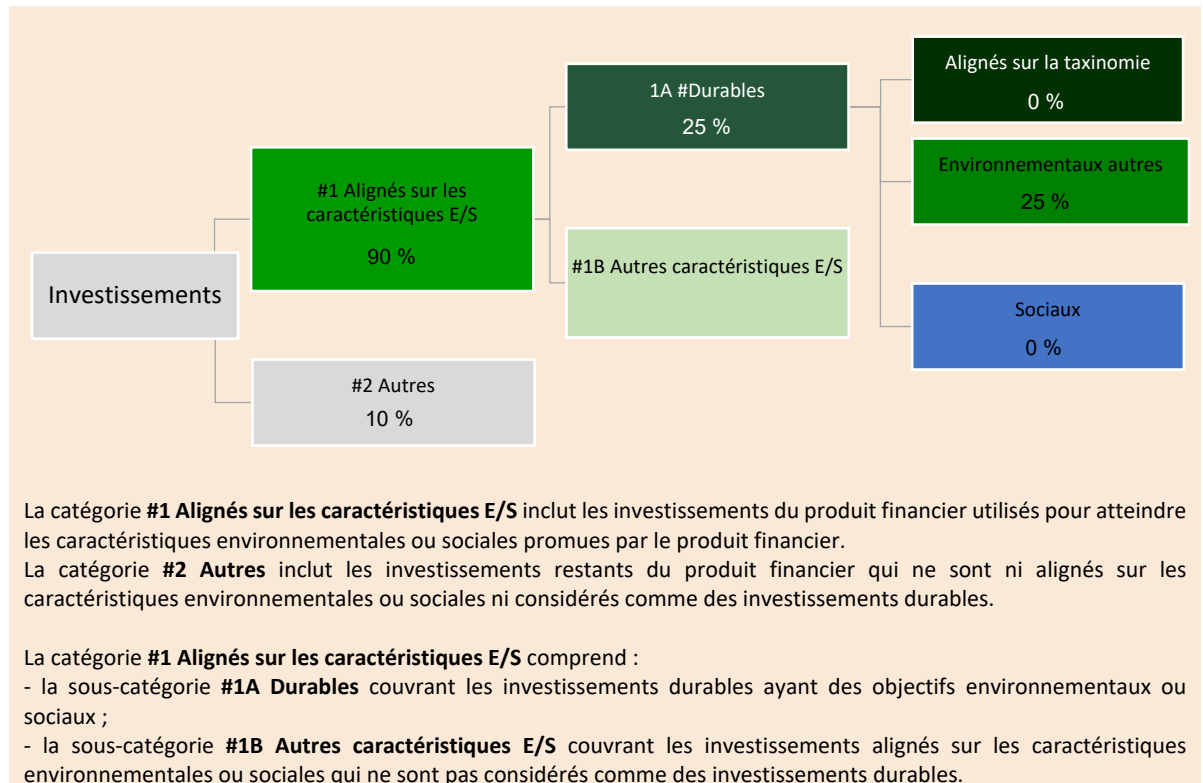
En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 25 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés atteint-elle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>6</sup> ?**

Oui :

Dans le gaz fossile

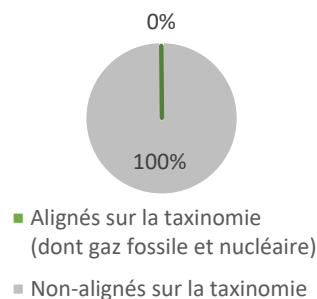
Dans l'énergie nucléaire

Non

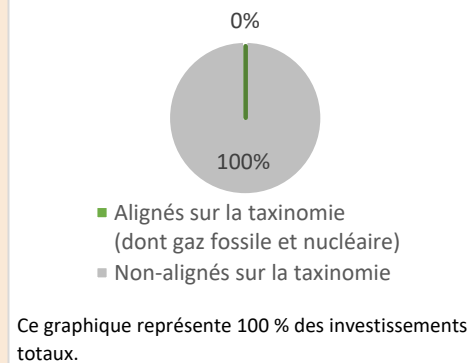
Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines\*



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, autres que les obligations souveraines\*



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>6</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 25 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 25 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Health Care Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés du secteur de la santé de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de soins de santé sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des soins de santé comprend les

prestataires et les services de soins de santé, les entreprises qui fabriquent et distribuent des équipements et des fournitures de soins de santé, ainsi que les sociétés de technologie de soins de santé. Il inclut également les sociétés impliquées dans la recherche, le développement, la production et la commercialisation de produits pharmaceutiques et biotechnologiques. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

● **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



**Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Dénomination du produit :  
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :  
2138009H295UEFKR3145

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_%



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 20 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Industrials Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en

appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Industrials Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement.
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

**Les indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● ***Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?***

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie.

La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier décile du secteur).

**Les principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de personnel, au respect des droits

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de Principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes

évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



### **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence

négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu](https://www.amundi.lu) <https://about.amundi.com/esg-documentation>

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Industrials Weighted & Screened Index (l'« Indice »).

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Industrials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés industrielles de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés industrielles sont identifiées par référence au GICS. Le secteur industriel comprend les fabricants et les distributeurs de biens d'équipement tels que l'aérospatiale et la défense, les produits de construction, les équipements et machines électriques et les entreprises qui proposent des services de construction et d'ingénierie. Il comprend également les fournisseurs de services commerciaux et professionnels, y compris les services d'impression, environnementaux et d'installations, les services et fournitures de bureau, les services de sécurité et d'alarme, les services de ressources humaines et d'emploi, les services de recherche et de conseil. Il inclut également les sociétés qui proposent des services de transport. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

**La stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumineux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;

5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la Note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/).

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

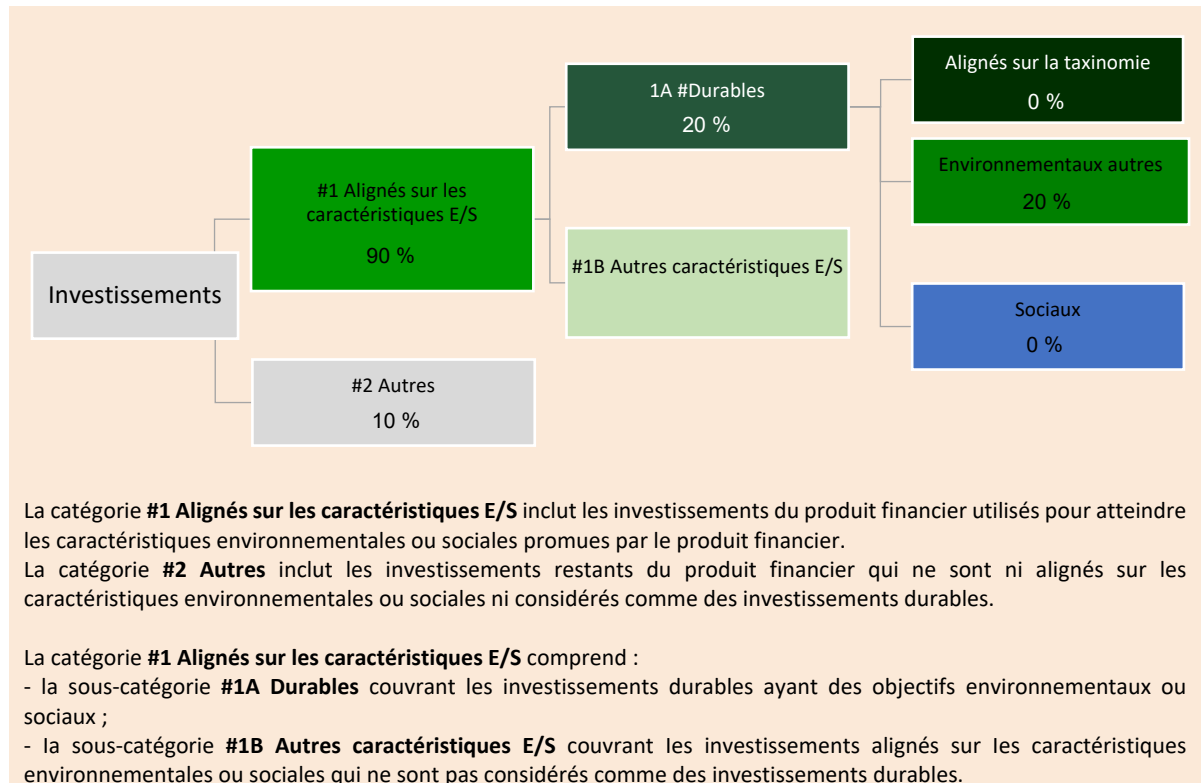
En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 20 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>7</sup> ?**

Oui :

Dans le gaz fossile

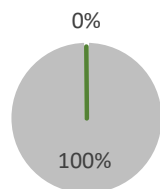
Dans l'énergie nucléaire

Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

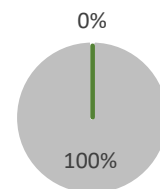
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines\*



■ Alignés sur la taxinomie (dont gaz fossile et nucléaire)  
■ Non-alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, autres que les obligations souveraines\*



■ Alignés sur la taxinomie (dont gaz fossile et nucléaire)  
■ Non-alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100 % des investissements totaux.

\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le Fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>7</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 20 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 20 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Industrials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés industrielles de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés industrielles sont identifiées par référence au GICS. Le secteur industriel comprend les fabricants et les

distributeurs de biens d'équipement tels que l'aérospatiale et la défense, les produits de construction, les équipements et machines électriques et les entreprises qui proposent des services de construction et d'ingénierie. Il comprend également les fournisseurs de services commerciaux et professionnels, y compris les services d'impression, environnementaux et d'installations, les services et fournitures de bureau, les services de sécurité et d'alarme, les services de ressources humaines et d'emploi, les services de recherche et de conseil. Il inclut également les sociétés qui proposent des services de transport. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

- **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



- **Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Dénomination du produit :  
Amundi S&P World Information Technology Screened  
UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :  
213800GUG4M6SPEBIP04

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_ %



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 30 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Information Technology Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en

appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Information Technology Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement.
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

Les **indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● **Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie. La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

● **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier décile du secteur).

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de personnel, au respect des droits

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques.

Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail.

En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



## **Le produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu https://about.amundi.com/esg-documentation](https://about.amundi.com/esg-documentation)

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Information Technology Weighted & Screened Index (l'« Indice »). L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Information Technology Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de technologies de l'information de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés des technologies de l'information sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des technologies de l'information comprend les sociétés qui proposent des logiciels et des services de technologie de l'information, les fabricants et les distributeurs de matériel et d'équipements technologiques tels que les équipements de communication, les téléphones portables, les ordinateurs, les équipements électroniques et les semi-conducteurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

**La stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note ESG S&P Global se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note ESG S&P Global, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

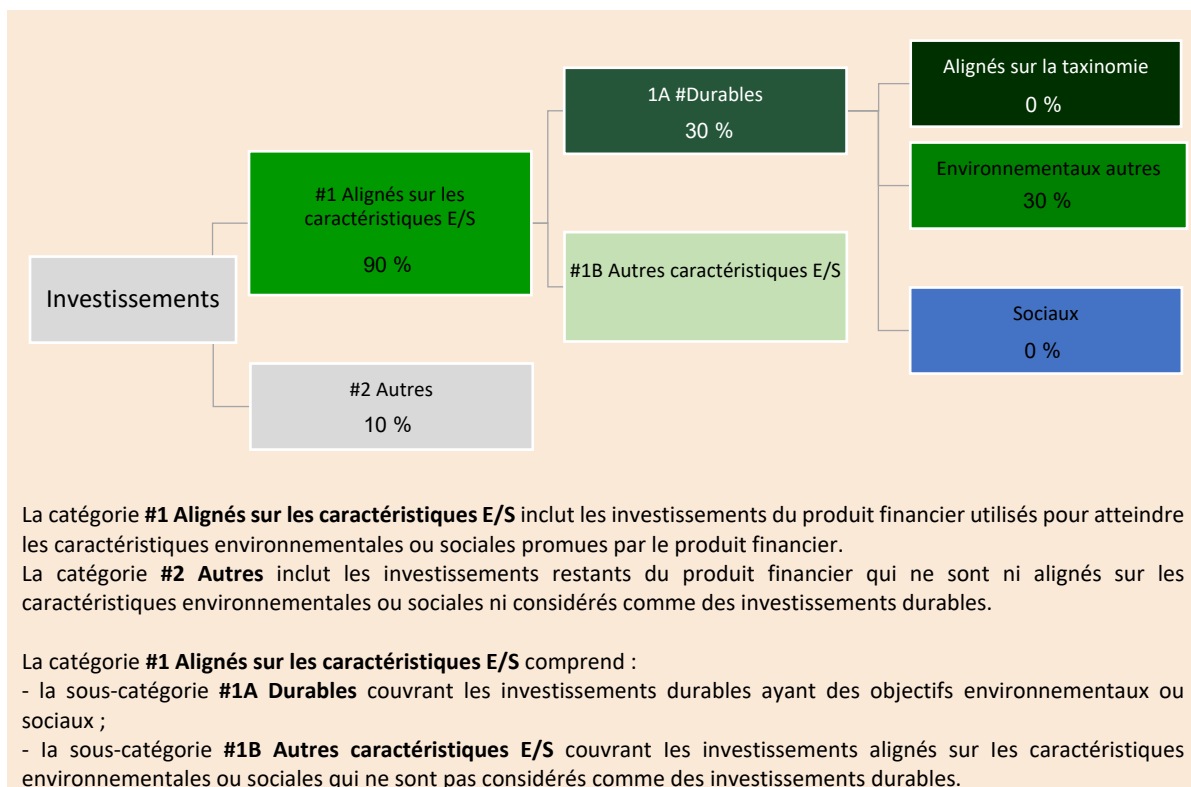
En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 30 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>8</sup> ?**

Oui :

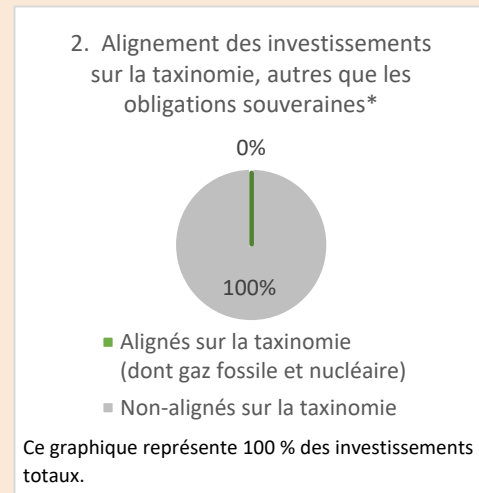
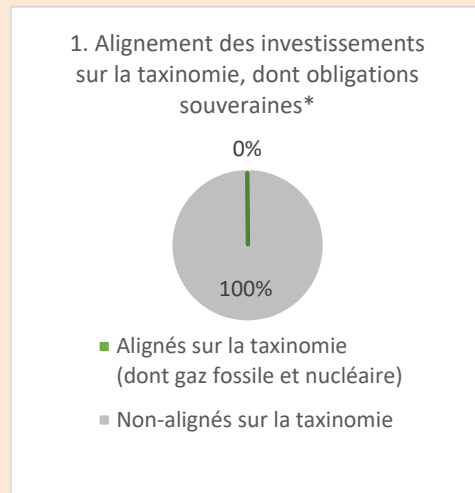
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le Fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>8</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 30 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 30 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Information Technology Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de technologies de l'information de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés des technologies de l'information sont identifiées par référence au GICS.

Le secteur des technologies de l'information comprend les sociétés qui proposent des logiciels et des services de technologie de l'information, les fabricants et les distributeurs de matériel et d'équipements technologiques tels que les équipements de communication, les téléphones portables, les ordinateurs, les équipements électroniques et les semi-conducteurs. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

● **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



**Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Dénomination du produit :  
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :  
213800PVS4JGTSRLOF83

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_%



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 25 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Materials Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en

appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Materials Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement.
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

**Les indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● ***Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?***

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie. La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

- **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier décile du secteur).

**Les principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de personnel, au respect des droits

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de Principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes

évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



### **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence

négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu](https://www.amundi.lu) <https://about.amundi.com/esg-documentation>

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Materials Weighted & Screened Index (l'« Indice »).

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Materials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de matériaux de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de matériaux sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des matériaux comprend les sociétés qui fabriquent des produits chimiques, des matériaux de construction, du verre, du papier, des produits forestiers et des produits d'emballage connexes, ainsi que les sociétés métallurgiques, de minéraux et minières, y compris les producteurs d'acier. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

**La stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quelles sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

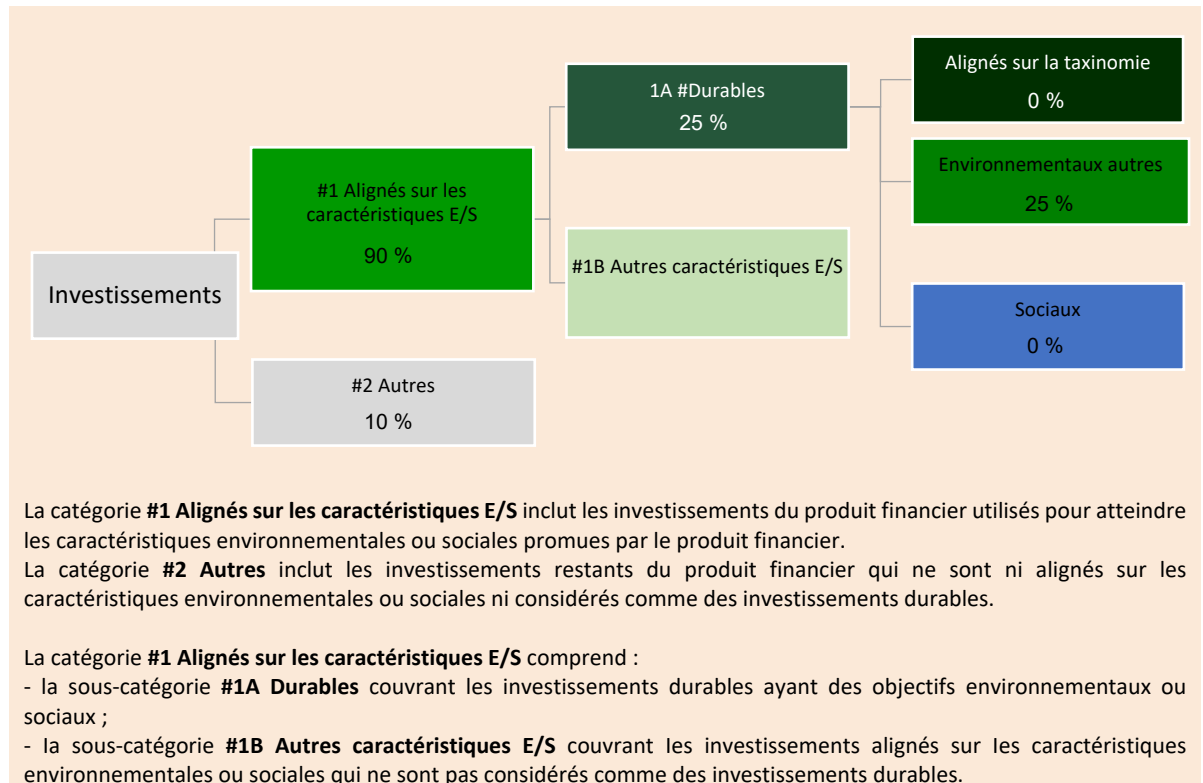
En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 25 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

- **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>9</sup> ?**

Oui :

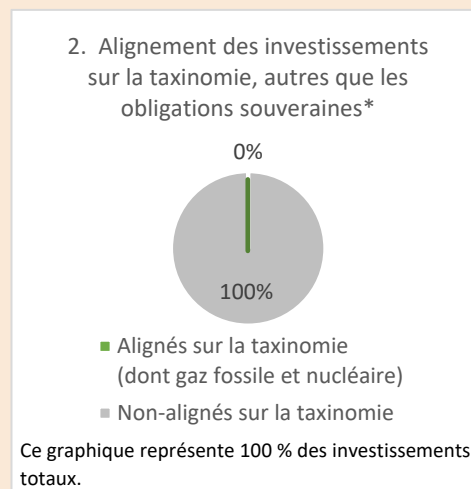
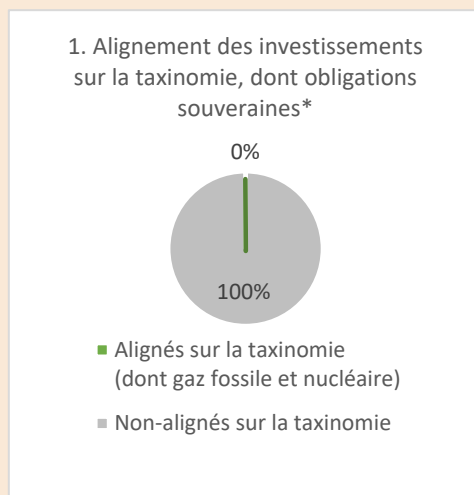
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

- **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le Fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>9</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 25 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 25 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Materials Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de matériaux de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de matériaux sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des matériaux comprend les sociétés qui

fabriquent des produits chimiques, des matériaux de construction, du verre, du papier, des produits forestiers et des produits d'emballage connexes, ainsi que les sociétés métallurgiques, de minéraux et minières, y compris les producteurs d'acier. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

● ***Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?***

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



**Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Dénomination du produit :  
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :  
213800Y8Q2JPGGCV3738

## Caractéristiques environnementales et/ou sociales

### Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif environnemental : \_\_\_ %



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il réalisera un minimum d'investissements durables ayant un objectif social : \_\_\_%



Il promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de \_\_\_ 10 % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier investit appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



### Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier ?

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Utilities Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en appliquant une série de

filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Utilities Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement.
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

**Les indicateurs de durabilité** servent à vérifier si le produit financier est conforme aux caractéristiques environnementales ou sociales promues.

● ***Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?***

L'utilisation des notes S&P Global ESG permet de mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier.

S&P Global Sustainable fournit les notes ESG (environnementales, sociales et de gouvernance) (collectivement appelées les « notes ESG S&P Global »), qui mesurent la performance globale des entreprises par rapport aux facteurs ESG financièrement importants. Les notes S&P Global ESG sont l'agrégation de trois notes de niveau dimensionnel : l'environnement, le social, et la gouvernance et l'économie.

La base de données des notes S&P Global ESG contient une note ESG total au niveau de l'entreprise pour un exercice financier et se compose de scores individuels pour les dimensions environnementales (E), sociales (S) et de gouvernance (G), sous lesquels se trouvent (en moyenne) plus de 20 scores de critères spécifiques au secteur qui peuvent être utilisés comme signaux des risques et des répercussions ESG.

Plus précisément, l'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent l'Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumeux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiants selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note S&P Global ESG se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent
- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note S&P Global ESG, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/).

- **Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre et comment les investissements effectués contribuent-ils à ces objectifs ?**

Bien que le Compartiment n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il investira une proportion minimale de ses actifs dans des investissements durables tels que définis à l'Article 2 (17) du SFDR, comme l'investissement dans des sociétés bénéficiaires d'investissements qui cherchent à répondre à deux critères :

- 1) suivre les bonnes pratiques environnementales et sociales ; et
- 2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour qu'une entreprise soit réputée contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit être la « meilleure » de son secteur d'activité pour au moins l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants. La définition de « la plus performante » repose sur la méthodologie ESG propriétaire d'Amundi qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire des investissements. Pour être considérée comme « la plus performante », une société bénéficiaire des investissements doit obtenir la meilleure des trois plus hautes notations (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) dans son secteur sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux majeurs sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs majeurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extrafinancières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme majeurs représentent plus de 10 % de la note ESG globale. Par exemple pour le secteur de l'énergie, les facteurs majeurs sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, communautés locales et droits de l'homme. Pour un aperçu plus complet, veuillez consulter la Politique Globale d'Investissement Responsable d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/>.

En outre, les sociétés bénéficiaires d'investissement ne doivent pas avoir d'exposition significative à certaines activités (par ex. le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique). Pour un aperçu plus complet des secteurs et des facteurs, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>. Le caractère durable d'un investissement est évalué au niveau de l'entreprise. En appliquant la définition d'Investissement durable d'Amundi décrite ci-dessus aux composants de l'Indice de ce Produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit a la proportion minimale d'investissements durables mentionnée à la page 1 ci-dessus. Cependant, veuillez noter que la définition de l'Investissement durable d'Amundi n'est pas mise en œuvre au niveau de la méthodologie de l'Indice.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend notamment poursuivre ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe « do no significant harm » ou « DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables (par ex. Intensité des Gaz à Effet de Serre ou GES des entreprises) via une combinaison d'indicateurs (par ex. intensité carbone) et des seuils ou règles spécifiques (par ex. que l'intensité carbone de l'entreprise ne soit pas dans le dernier décile du secteur).

**Les principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociétales et de personnel, au respect des droits

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre qui ne tient pas compte des indicateurs obligatoires de Principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'a pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E selon la notation ESG d'Amundi.

– *Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?*

Les indicateurs d'incidences négatives ont été pris en compte comme détaillé dans le premier filtre DNSH ci-dessus :

Le premier filtre DNSH repose sur le contrôle des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives de l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS lorsqu'il existe des données fiables via la combinaison des indicateurs et des seuils ou règles spécifiques suivants :

- une intensité en CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur (ne s'applique qu'aux secteurs à forte intensité), et
- un Conseil d'administration dont le niveau de diversité n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés du secteur, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme, et
- ne pas faire l'objet de controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Dans sa politique d'exclusion découlant de sa Politique d'Investissement Responsable, Amundi tient déjà compte de Principales incidences négatives spécifiques. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

– *Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :*

Les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propriétaire évalue les émetteurs à l'aide des données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle dispose d'un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, Amundi effectue un suivi des controverses au moins une fois par trimestre, qui inclut les sociétés identifiées pour des violations des droits de l'homme. En cas de controverse, les analystes

évaluent la situation, lui donnent un score (à l'aide de notre méthodologie de notation propriétaire) et déterminent la marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour chaque trimestre pour suivre les évolutions et les efforts de correction.

*La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.*

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

*Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.*



## **Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?**

Oui, le Compartiment prend en compte les principales incidences négatives, conformément à l'Annexe 1, Tableau 1 des RTS, applicables à la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et les secteurs, qui couvrent certains des principaux indicateurs négatifs de durabilité énumérés par le Règlement SFDR. Comme détaillé dans la Politique Globale d'investissement responsable d'Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), les exclusions basées sur l'activité concernent les émetteurs impliqués dans la fabrication, le commerce, le stockage ou les services pour les mines antipersonnel et les bombes à sous-munitions, les armes chimiques, biologiques et à uranium appauvri ou les armes nucléaires, ou les émetteurs qui enfreignent gravement et de manière répétée un ou plusieurs des dix principes du Pacte mondial des Nations unies. Les exclusions sectorielles portent sur le charbon thermique, les combustibles fossiles non conventionnels et le tabac.

- Engagement : L'engagement est un processus permanent et ciblé qui vise à influencer les activités ou le comportement des sociétés. L'objectif des activités d'engagement peut se diviser en deux catégories°: engager un émetteur à améliorer la manière dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société au sens large et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme qui peuvent influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, veuillez consulter la Politique de vote d'Amundi disponible sur <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui s'appuie sur les données de trois fournisseurs de données externes (MSCI, Sustainalytics et ISS ESG) pour suivre systématiquement l'évolution des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par des analystes ESG dans le cadre d'un examen périodique. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur le mode d'utilisation obligatoire des principaux indicateurs d'incidence négative, veuillez consulter la Déclaration relative à la mise en application du Règlement SFDR d'Amundi disponible sur [www.amundi.lu https://about.amundi.com/esg-documentation](https://about.amundi.com/esg-documentation)

Non



## Quelle est la stratégie d'investissement suivie par ce produit financier ?

Répliquer la performance du S&P World Utilities Weighted & Screened Index (l'« Indice »). L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Utilities Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services publics de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de services publics sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des services publics comprend des sociétés de services publics tels que l'électricité, le gaz et l'eau. Il comprend également des producteurs d'électricité indépendants et des négociants en énergie, ainsi que des sociétés qui s'engagent dans la production et la distribution d'électricité à partir de sources renouvelables. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

La stratégie d'investissement guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

### ● **Quels sont les contraintes définies dans la stratégie d'investissement pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier ?**

Il s'agit d'un ETF à gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de suivi associée.

L'univers initial de l'Indice comprend tous les titres qui composent son Indice parent.

Les filtres suivants sont ensuite appliqués :

1. Les sociétés impliquées dans des activités commerciales identifiées conformément à la méthodologie de l'Indice publiée, y compris le tabac, le charbon thermique, les armes controversées, les contrats militaires, les armes légères, les sables bitumineux, le schiste bitumineux, le pétrole et le gaz arctiques sont exclues ;
2. Exclusion des entreprises aux scores disqualifiant selon le Pacte mondial des Nations unies (PMNU)\* ;
3. Les sociétés impliquées dans des controverses ESG\* importantes comme celles liées à la criminalité économique et la corruption, la fraude, des pratiques commerciales illégales, des problèmes relatifs aux droits de l'homme, des conflits du travail, la sécurité sur le lieu de travail, des accidents catastrophiques sont exclues ;
4. Les sociétés qui n'ont pas de note ESG S&P Global\* sont exclues ;
5. Les sociétés qui figurent dans les 5 % des pires notes ESG de l'univers sectoriel GICS concerné sont exclues. L'évaluation de la note ESG S&P Global se concentre sur des critères de durabilité financièrement pertinents pour la performance d'entreprise, l'évaluation et la sélection des titres.

Les composantes éligibles de l'Indice sont sélectionnées dans l'univers restant sous réserve des contraintes d'optimisation suivantes :

- réduction de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre d'au moins 30 % par rapport à l'Indice parent

- note ESG S&P Global identique ou amélioration de la note ESG S&P Global par rapport à l'Indice parent.

\* Pour de plus amples informations sur la note ESG S&P Global, la note PMNU et les controverses ESG, veuillez vous référer à la méthodologie de l'Indice disponible sur [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/).

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites dans la Politique d'Investissement Responsable d'Amundi.

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

● ***Dans quelle proportion minimale le produit financier s'engage-t-il à réduire son périmètre d'investissement avant l'application de cette stratégie d'investissement ?***

Il n'existe pas de taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

● ***Quelle est la politique mise en œuvre pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ?***

Amundi fait appel à la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG propriétaire qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris les critères de gouvernance. Dans la dimension Gouvernance, Amundi évalue la capacité d'un émetteur à assurer un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par ex. qui garantit la valeur de l'émetteur à long terme). Les sous-critères de gouvernance considérés sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et les contrôles, les rémunérations, les droits des actionnaires, la déontologie, les pratiques fiscales et la stratégie ESG. L'échelle de notation ESG d'Amundi comprend sept notes, allant de A à G, A étant la meilleure et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de l'univers d'investissement.

Chaque titre d'entreprise (actions, obligations, produits dérivés portant sur un seul émetteur, ETF actions et obligataires ESG) inclus dans les portefeuilles a fait l'objet d'une évaluation de bonnes pratiques de gouvernance en appliquant un filtre normatif des principes du Pacte mondial de l'ONU (PM de l'ONU) à l'émetteur associé. L'évaluation est continue. Le Comité de notation ESG d'Amundi examine chaque mois les listes des sociétés qui ne respectent pas le Pacte mondial des Nations Unies entraînant une dégradation de leur notation à G. Le désinvestissement des titres dégradés en G est effectué par défaut dans un délai de 90 jours.

La Politique de gestion d'Amundi (engagement et vote) relative à la gouvernance vient compléter cette approche.



## Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier ?

L'**allocation des actifs** décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

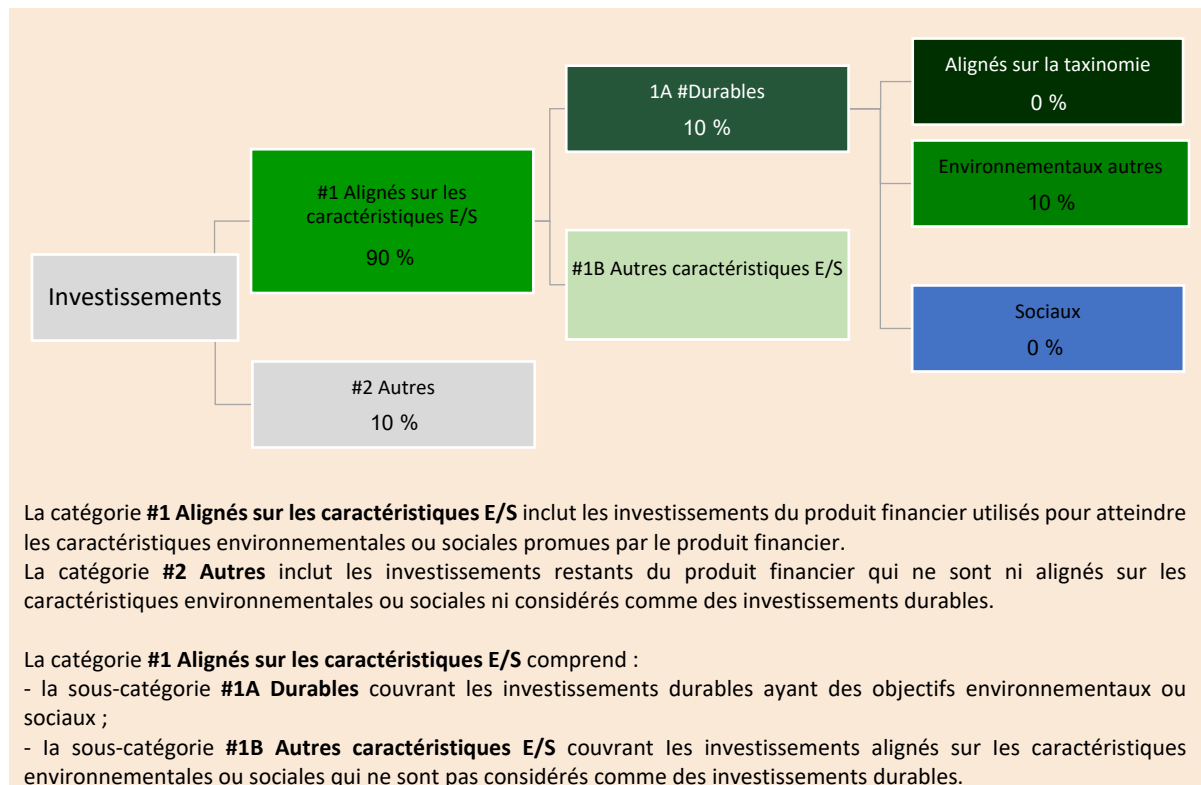
En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 10 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux ;

- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

### ● **Comment l'utilisation de produits dérivés permet-elle d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Aucun instrument dérivé n'est utilisé pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.



## Dans quelle proportion minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements ayant un objectif environnemental et alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à respecter un minimum d'investissements durables avec un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE, y compris concernant les investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

### ● **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE<sup>10</sup> ?**

Oui :

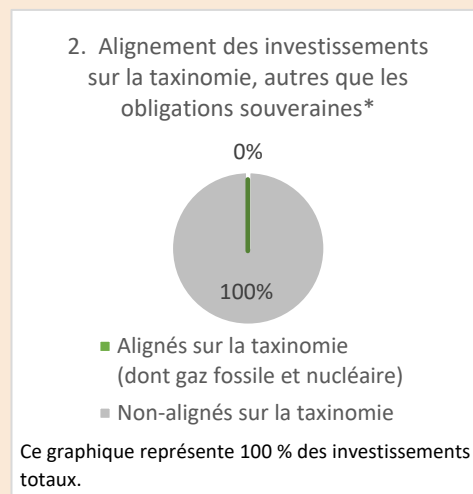
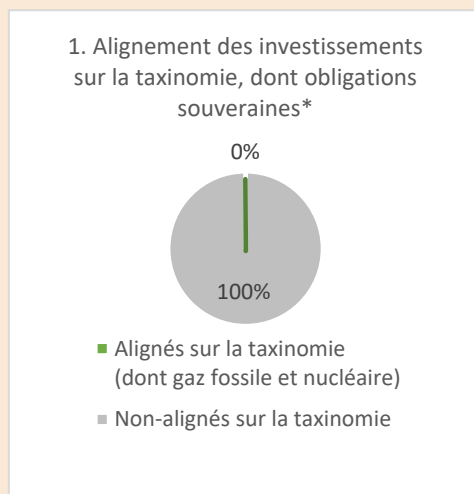
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

**Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines\* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.**



\* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

### ● **Quelle est la proportion minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Le fonds n'a pas fixé de part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes.

<sup>10</sup> Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental, mais la part des investissements durables sur le plan environnemental et social sera au total d'au moins 10 %.



### Quelle est la proportion minimale d'investissements durables sur le plan social ?

Bien que le Compartiment n'ait pas l'intention d'allouer une part minimale à des investissements durables sur le plan social, la part des investissements durables sur le plan environnemental et social s'élèvera au total à au moins 10 %.



### Quels sont les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle est leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquent-elles à eux ?

Cette catégorie peut être composée de liquidités, de produits dérivés et de sociétés pour lesquelles il n'y a pas de couverture financière supplémentaire.



### Un indice spécifique est-il désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet ?

Oui, l'Indice a été désigné comme référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

- **Comment l'indice de référence est-il aligné en permanence sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier ?**

Selon les réglementations applicables aux promoteurs d'indices (y compris BMR), les promoteurs d'indices doivent définir des contrôles/diligences appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indices réglementés. En outre, à chaque rééquilibrage de l'indice, le fournisseur d'indices applique les critères de sélection ESG à l'Indice parent pour exclure les émetteurs qui ne répondent pas à ces critères de sélection ESG.

- **Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il à tout moment garanti ?**

L'objectif d'investissement du Compartiment est de reproduire la performance de l'Indice.

- **En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent ?**

L'Indice est un indice d'actions qui mesure la performance de titres de participation éligibles du S&P World Utilities Index (l'« Indice parent »). L'Indice parent est conçu pour mesurer la performance de sociétés de services publics de grande et moyenne capitalisation sur les marchés développés (selon la définition de S&P), qui représentent approximativement 85 % du capital total disponible. Les sociétés de services publics sont identifiées par référence au GICS. Le secteur des services publics comprend des sociétés de services publics tels que l'électricité, le gaz et l'eau. Il comprend également des producteurs

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

d'électricité indépendants et des négociants en énergie, ainsi que des sociétés qui s'engagent dans la production et la distribution d'électricité à partir de sources renouvelables. L'Indice est sélectionné et pondéré pour améliorer les profils ESG et réduire l'empreinte carbone, le tout par rapport à l'Indice parent.

- **Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné ?**

Des informations supplémentaires sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : [www.spglobal.com/spdji/](http://www.spglobal.com/spdji/)



**Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit ?**

**De plus amples informations sur le produit sont accessibles sur le site internet :** Des informations supplémentaires sur le Compartiment sont disponibles sur le site [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

## Exposition globale et effet de levier

Modification du nom des Compartiments suivants dans le tableau de la section du Prospectus intitulée « Exposition globale et effet de levier » pour refléter le changement de nom du compartiment :

Compartiment	Méthodologie de calcul de l'exposition globale	Effet de levier
Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL
Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF	Approche par les Engagements	100 % de la VL

## Utilisation d'opérations de financement sur titres et de swaps sur rendement total

Modification du nom des Compartiments dans le tableau de la section du Prospectus intitulée « Utilisation d'opérations de financement sur titres et de swaps sur rendement total » :

COMPARTIMENTS	Mise en pension – attendu (%)	Mise en pension – Max (%)	Prise en pension – attendu (%)	Prise en pension – Max (%)	Prêt titres – attendu (%)	Prêt titres – Max (%)	Emprunt titres – attendu (%)	Emprunt titres – Max (%)	TRS – attendu (%)	TRS – Max (%)
Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0
Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20 %	33,3 %	0	0	0	0

## Investissement durable

Modification du nom des Compartiments à la section suivante du Prospectus sous la rubrique « Investissement durable ».

Les Compartiments énumérés ci-dessous sont classifiés conformément à l'article 8 du Règlement sur la publication d'informations et visent à promouvoir des caractéristiques environnementales ou sociales :

<b>COMPARTIMENTS</b>
Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF

## Loi allemande sur la fiscalité des investissements

Modification du nom des Compartiments dans le tableau de la section « Loi allemande sur la fiscalité des investissements » ;

<b>COMPARTIMENTS</b>	<b>% de l'actif brut investi en actions (comme défini par l'« InvStg »)</b>
Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF	60 %
Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF	60 %