

# Amundi MSCI EMU ESG Selection IE

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/03/2026

ACTIONS ■

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : (C) 2 901,30 (EUR)  
(D) 1 895,53 (EUR)

Date de VL et d'actif géré : 31/03/2026

Actif géré : 1 858,62 (millions EUR)

Code ISIN : (C) LU0389810994  
(D) LU0389811026

Code Bloomberg : (C) CAIDXIC LX  
(D) CAIDXID LX

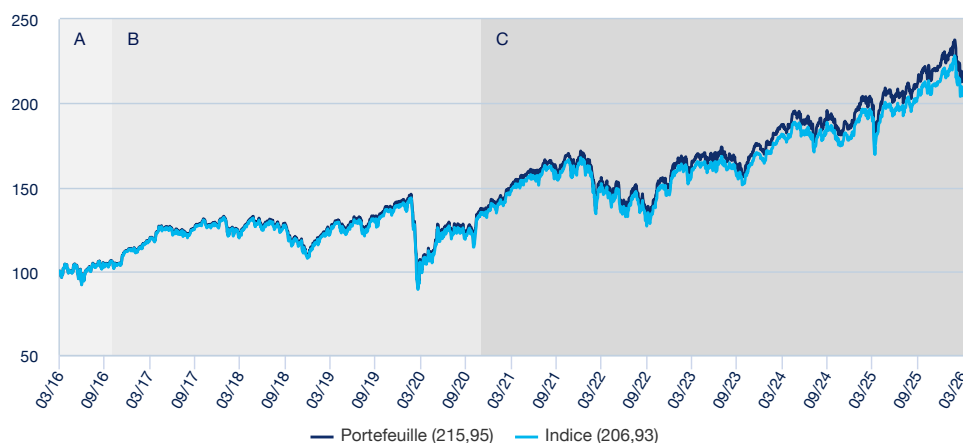
Indice de référence :  
100% MSCI EMU ESG SELECTION P-SERIES 5%  
ISSUER CAPPED INDEX

## Objectif d'investissement

AMUNDI MSCI EMU ESG Selection a pour objectif de répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (Total return index) à la hausse comme à la baisse. Ce compartiment permet une exposition aux actions d'entreprises de grandes et moyennes capitalisations boursières de 10 pays développés de la zone Euro et dotées des meilleures notations en termes environnementaux, sociaux et de gouvernance. Les entreprises impliquées dans l'énergie nucléaire, le tabac, le charbon, l'alcool, le jeu, les armes militaires, les armes à feu civiles sont exclues de l'indice et chaque poids constitutif est plafonné à 5%.

## Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

### Evolution de la performance (base 100) \* (Source : Fund Admin)



A : Simulation effectuée sur la base des performances réalisées entre le 23 septembre 2008 et le 30 octobre 2016 par le Compartiment luxembourgeois « INDEX EQUITY EURO » de la SICAV « AMUNDI FUNDS » gérée par Amundi Asset Management et absorbée par AMUNDI INDEX MSCI EMU le 31 octobre 2016.

B : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment a été l'indice MSCI EMU.

C : Depuis le début de cette période, l'indicateur de référence du compartiment est MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped

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

Depuis le	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Depuis le
	31/12/2025	27/02/2026	31/12/2025	31/03/2025	31/03/2023	31/03/2021	31/03/2016	23/09/2008
<b>Portefeuille</b>	-3,22%	-8,83%	-3,22%	10,13%	30,52%	43,32%	115,95%	190,78%
<b>Indice</b>	-3,42%	-9,03%	-3,42%	9,41%	28,72%	39,78%	106,93%	172,63%
<b>Ecart</b>	0,20%	0,20%	0,20%	0,71%	1,80%	3,54%	9,02%	18,15%

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

	2025	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
<b>Portefeuille</b>	19,77%	6,60%	17,18%	-10,89%	21,43%	-1,28%	28,75%	-14,65%	13,61%	3,79%
<b>Indice</b>	19,16%	6,07%	16,69%	-11,35%	20,74%	-1,48%	28,17%	-14,98%	13,39%	3,49%
<b>Ecart</b>	0,60%	0,53%	0,49%	0,46%	0,70%	0,20%	0,59%	0,32%	0,22%	0,30%

\* Source : Amundi. Les performances nettes ci-dessus couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile. **Les performances passées ne préjugent en rien des résultats actuels et futurs et ne sont pas garantes des rendements à venir.** Les gains ou pertes éventuels ne prennent pas en compte les frais, commissions et redevances éventuels supportés par l'investisseur lors de l'émission et du rachat des parts (ex : taxes, frais de courtage ou autres commissions prélevés par l'intermédiaire financier...). Si les performances sont calculées dans une devise autre que l'euro, les gains ou les pertes éventuellement générés peuvent de ce fait être impactés par les fluctuations des taux de change (à la hausse comme à la baisse). L'écart correspond à la différence de performance du portefeuille et de l'indice.

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



Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 5 ans.

Le SRI représente le profil de risque tel qu'exposé dans le Document d'Information Clé (DIC). La catégorie la plus basse ne signifie pas qu'il n'y a pas de risque.

L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

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

	1 an	3 ans	5 ans
<b>Volatilité du portefeuille</b>	16,40%	13,90%	15,24%
<b>Volatilité de l'indice</b>	16,01%	13,62%	14,98%
<b>Tracking Error ex-post</b>	1,24%	1,07%	1,00%
<b>Ratio de sharpe</b>	0,29	0,41	0,36
<b>Ratio d'information</b>	0,16	0,39	0,49

\* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an.

Le Ratio de sharpe est un indicateur statistique qui mesure la performance du portefeuille par rapport à un placement sans risque

ACTIONS ■

Rencontrez l'équipe



**Lionel Brafman**  
Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie



**Vincent Masson**  
Gérant de portefeuille senior - Index & Multistratégies



**Jerome Gueguen**  
Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped est un indice d'actions basé sur l'indice MSCI EMU (l'« Indice cadre »), représentatif des titres de moyenne à grande capitalisation de 10 pays développés (en septembre 2020) de l'Union économique et monétaire européenne et émis par des sociétés assorties de notations exceptionnelles en matière environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) dans chaque secteur de l'Indice cadre.

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Actions**  
Exposition : **Zone Euro**

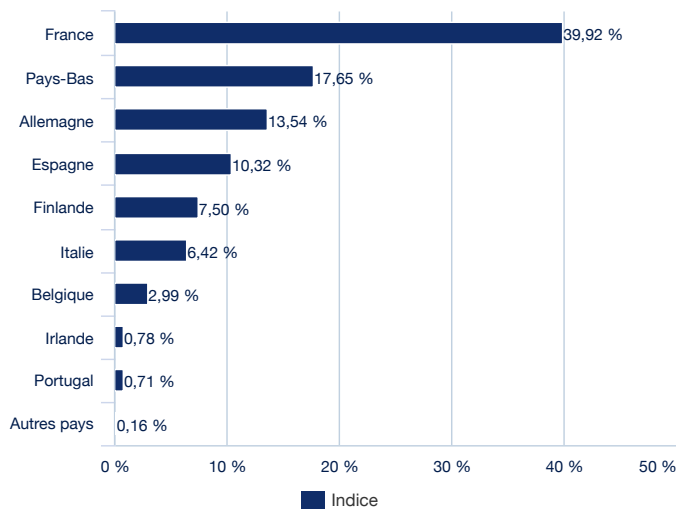
Nombre de valeurs : **104**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

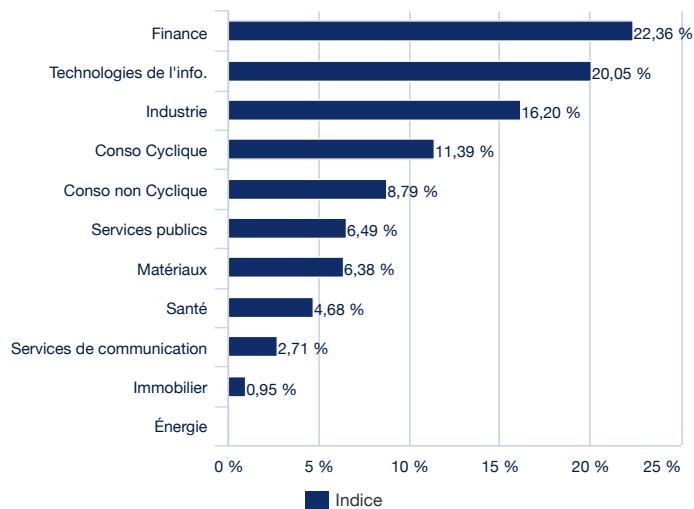
	% d'actifs (indice)
ASML HOLDING NV	7,15%
NOKIA OYJ	4,60%
IBERDROLA SA	4,52%
INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,51%
SCHNEIDER ELECT SE	4,44%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4,11%
AIR LIQUIDE SA	3,64%
L OREAL (PARIS)	3,00%
BNP PARIBAS	2,90%
INTESA SANPAOLO	2,53%
<b>Total</b>	<b>41,39%</b>

Informations fournies uniquement à titre illustratif et ne constituant pas une recommandation à l'achat ou à la vente d'un titre donné.

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Commentaire de gestion

Le déclenchement de la guerre en Iran a fortement pesé sur les marchés actions. Hors États-Unis, les marchés avaient globalement progressé jusqu'au 27 février, portés par le Japon et l'Europe, mais cette surperformance s'est inversée ensuite. Les actions américaines ont nettement consolidé : le S&P 500 reculait de 4,6 % en USD, tandis que l'Eurostoxx50 ne perdait que 3,8% en USD et restait proche de l'équilibre en EUR.

Plusieurs rotations ont marqué la période : consolidation chez les éditeurs de logiciels (craintes de forte disruption liée à l'IA) et rotation vers les fabricants de semi-conducteurs et leur chaîne de valeur. Les valeurs moyennes ont été privilégiées par rapport aux grandes capitalisations. La rotation initialement favorable à l'Europe et au Japon s'est inversée avec la remontée des prix du pétrole : le Stoxx Europe 600 affiche une perte de 5,5 % depuis le début du conflit en EUR. Sectoriellement, l'énergie progressent en fin de trimestre, tandis que les secteurs plus cycliques et sensibles à la demande restent sous pression.

## ACTIONS ■

## Caractéristiques principales (Source : Amundi)

Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Dépositaire	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Commissaire aux comptes	DELOITTE AUDIT
Date de création de la classe	29/06/2016
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	(C) Capitalisation (D) Distribution
Code ISIN	(C) LU0389810994 (D) LU0389811026
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation	0,15%
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	Eligible au PEA
Clôture fiscale	Septembre

## Avertissement

Ce document est fourni à titre d'information seulement et il ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation ou une offre, un conseil ou une invitation d'achat ou de vente des parts ou actions des FCP, FCPE, SICAV, compartiment de SICAV, SPPICAV présentés dans ce document (« les OPC ») et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. Ce document ne constitue pas la base d'un contrat ou d'un engagement de quelque nature que ce soit. Toutes les informations contenues dans ce document peuvent être modifiées sans préavis. La société de gestion n'accepte aucune responsabilité, directe ou indirecte, qui pourrait résulter de l'utilisation de toutes informations contenues dans ce document. La société de gestion ne peut en aucun cas être tenue responsable pour toute décision prise sur la base de ces informations. Les informations contenues dans ce document vous sont communiquées sur une base confidentielle et ne doivent être ni copiées, ni reproduites, ni modifiées, ni traduites, ni distribuées sans l'accord écrit préalable de la société de gestion, à aucune personne tierce ou dans aucun pays où cette distribution ou cette utilisation serait contraire aux dispositions légales et réglementaires ou imposerait à la société de gestion ou à ses fonds de se conformer aux obligations d'enregistrement auprès des autorités de tutelle de ces pays. Tous les OPC ne sont pas systématiquement enregistrés dans le pays de juridiction de tous les investisseurs. Investir implique des risques : les performances passées des OPC présentées dans ce document ainsi que les simulations réalisées sur la base de ces dernières, ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne préjugent pas des performances futures de ces derniers. Les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. Les prospectus complets des OPC de droit français visés par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sont disponibles gratuitement sur simple demande au siège social de la société de gestion. Concernant les mandats de gestion, ce document fait partie du relevé des activités de gestion de votre portefeuille et doit être lu conjointement avec tout autre relevé périodique ou avis de confirmation relatif aux opérations de votre portefeuille, fourni par votre teneur de compte. La source des données du présent document est la société de gestion sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.

Ce document est destiné à être remis exclusivement aux investisseurs institutionnels, professionnels, qualifiés ou sophistiqués et aux distributeurs. Ne doit pas être remis au grand public, à la clientèle privée et aux particuliers au sens de toute juridiction, ni aux "US Persons". Les investisseurs visés sont, en ce qui concerne l'Union Européenne, les investisseurs "Professionnels" au sens de la Directive 2004/39/CE du 21 avril 2004 "MIF" ou, le cas échéant au sens de chaque réglementation locale et, dans la mesure où l'offre en Suisse est concernée, les "investisseurs qualifiés" au sens des dispositions de la Loi fédérale sur les placements collectifs (LPCC), de l'Ordonnance sur les placements collectifs du 22 Novembre 2006 (OPCC) et de la Circulaire FINMA 08/8 au sens de la législation sur les placements collectifs du 20 Novembre 2008. Ce document ne doit en aucun cas être remis dans l'Union Européenne à des investisseurs non "Professionnels" au sens de la MIF ou au sens de chaque réglementation locale, ou en Suisse à des investisseurs qui ne répondent pas à la définition d'"investisseurs qualifiés" au sens de la législation et de la réglementation applicable.