

# Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned UCITS ETF

REPORT  
MENSILE

30/09/2026

## Obiettivo di investimento

Il Comparto è gestito passivamente. L'obiettivo del presente Comparto consiste nel replicare la performance di MSCI Emerging Markets SRI filtered PAB Index (l'"Indice") e ridurre al minimo il tracking error tra il valore patrimoniale netto del comparto e il rendimento dell'Indice. Il livello previsto di tracking error, in condizioni di mercato normali, è indicato nel prospetto del Comparto. L'Indice è un indice a rendimento totale: i dividendi al netto d'imposta corrisposti dagli elementi costitutivi dell'Indice sono inclusi nel rendimento dell'Indice. Il Comparto promuove caratteristiche ambientali e/o sociali attraverso, tra l'altro, la replica di un Indice che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è un indice azionario basato sull'indice MSCI Emerging Markets, rappresentativo dei titoli a capitalizzazione medio-alta di 27 paesi emergenti (a novembre 2021) (l'"Indice principale"). L'Indice offre esposizione a società con rating ESG eccezionali ed esclude le società i cui prodotti hanno un impatto negativo sul fronte sociale o ambientale. Inoltre, l'Indice mira a rappresentare la performance di una strategia che pondera più volte i titoli in base alle opportunità e ai rischi associati alla transizione climatica, al fine di soddisfare i requisiti minimi del Regolamento UE sui benchmark dell'Accordo di Parigi (EU PAB). I temi ESG chiave comprendono principalmente l'intensità delle emissioni di carbonio. Per ulteriori informazioni sulle esclusioni applicate dall'Indice ai sensi degli indici di riferimento UE allineati all'accordo di Parigi (PAB), si rimanda alla sezione "Orientamenti sull'utilizzo di termini ESG o relativi alla sostenibilità nella denominazione dei fondi" del Prospetto. I limiti dell'approccio adottato sono descritti nel prospetto del Comparto attraverso fattori di rischio quali il Rischio di investimento sostenibile. Il punteggio ESG delle società viene calcolato da un'agenzia di rating ESG, utilizzando dati "grezzi", modelli e stime raccolti/calcolati con metodi specifici per ciascun fornitore. Vista la mancanza di standardizzazione e l'unicità di ciascuna metodologia, le informazioni fornite potrebbero non essere complete. La valutazione dei rischi di sostenibilità è complessa e può basarsi su dati ESG difficili da ottenere, incompleti, stimati, non aggiornati e/o altrimenti sostanzialmente imprecisi. Anche se identificati, non vi è alcuna garanzia che questi dati saranno valutati correttamente. L'esposizione all'Indice sarà conseguita attraverso una Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee rappresentative degli elementi costitutivi dell'Indice in una proporzione estremamente simile alla loro quota nell'Indice. Il Gestore degli investimenti potrà utilizzare derivati al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché qualora ciò consenta una migliore esposizione a un elemento costitutivo dell'Indice. Al fine di generare reddito aggiuntivo per compensare i costi, il Comparto può anche effettuare operazioni di prestito titoli.

## Performance del fondo \* (Fonte : Fund Admin)



## Indicatori di rischio (Fonte : Fund Admin)

|                                 | 1 anno | 3 anni | Data di lancio * |
|---------------------------------|--------|--------|------------------|
| <b>Volatilità</b>               | 17,53% | 15,82% | 18,82%           |
| <b>Volatilità dei benchmark</b> | 17,53% | 15,84% | 18,87%           |
| <b>Tracking Error ex-post</b>   | 0,21%  | 0,28%  | 0,35%            |
| <b>Sharpe Ratio</b>             | 1,06   | 0,87   | 0,19             |

\* La volatilità è un indicatore statistico che misura l'ampiezza delle variazioni di un portafoglio rispetto alla sua media. Esempio: variazioni giornaliere di +/- 1,5% sui mercati corrispondono ad una volatilità annua del 25%. L'indicatore Tracking Error misura la differenza di rendimento tra il fondo e l'indice

## Performance\* (Fonte : Fund Admin)

| A partire dal      | Da inizio anno<br>31/12/2025 | 1 mese<br>31/08/2026 | 3 mesi<br>30/06/2026 | 1 anno<br>30/09/2025 | 3 anni<br>29/09/2023 | 5 anni<br>30/09/2021 | Da inizio gestione<br>22/01/2019 |
|--------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------------------|
| <b>Portafoglio</b> | 18,03%                       | 0,41%                | 1,68%                | 20,01%               | 65,48%               | 27,12%               | 65,65%                           |
| <b>Benchmark</b>   | 18,46%                       | 0,47%                | 1,78%                | 20,61%               | 67,98%               | 29,90%               | 71,55%                           |
| <b>Scostamento</b> | -0,43%                       | -0,06%               | -0,10%               | -0,60%               | -2,50%               | -2,78%               | -5,90%                           |

## Performance annuale\* (Fonte : Fund Admin)

|                    | 2025   | 2024   | 2023   | 2022    | 2021   | 2020   | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 |
|--------------------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|------|------|------|------|
| <b>Portafoglio</b> | 27,83% | 4,22%  | 1,87%  | -18,41% | -1,64% | 17,48% | -    | -    | -    | -    |
| <b>Benchmark</b>   | 28,38% | 4,93%  | 2,25%  | -18,26% | -1,27% | 17,72% | -    | -    | -    | -    |
| <b>Scostamento</b> | -0,56% | -0,70% | -0,38% | -0,15%  | -0,38% | -0,24% | -    | -    | -    | -    |

\* Le performance sopra indicate si riferiscono a periodi completi di 12 mesi per ogni anno civile. Le performance passate non sono assolutamente indicative dei risultati attuali e futuri e non garantiscono prossimi rendimenti. I guadagni o le perdite eventuali non tengono conto delle spese, delle commissioni e delle imposte eventualmente sostenute dall'investitore al momento dell'emissione o del riscatto delle quote (es. tasse, spese di intermediazione o altre commissioni prelevate dall'intermediario finanziario...). Se le performance sono calcolate in una valuta diversa dall'euro, i guadagni o le perdite eventualmente generate possono essere influenzate dalle oscillazioni dei tassi di cambio (sia in rialzo che in ribasso). Lo scostamento corrisponde alla differenza di performance del portafoglio e dell'indice.



Indicatore di rischio(Fonte : Fund Admin)



Rischio più basso

Rischio più alto

L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 5 anni.  
L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra incapacità di pagarvi quanto dovuto.

Abbiamo classificato questo prodotto al livello 4 su 7, che corrisponde alla classe di rischio media. Ciò significa che le perdite potenziali dovute alla performance futura del prodotto sono classificate nel livello medio e che potrebbe darsi che le cattive condizioni di mercato influenzino la nostra capacità di pagarvi quanto dovuto. Altri rischi aggiuntivi: Il rischio di liquidità del mercato potrebbe amplificare la variazione dei risultati generati dal prodotto. Questo prodotto non comprende alcuna protezione dalla performance futura del mercato; pertanto potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso. Oltre ai rischi inclusi nell'indicatore di rischio, vi sono altri rischi che possono influire sul rendimento del Comparto. Si rimanda al prospetto di Amundi Index Solutions.

Caratteristiche (fonte: Amundi)

|                                                                       |                                               |
|-----------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| VL                                                                    | A : 82,83 USD<br>D : 71,12 USD                |
| Patrimonio in gestione                                                | 3 191,11 ( milioni USD )                      |
| Commissioni di gestione e altri costi amministrativi o di esercizio * | 0,25%                                         |
| Data di valorizzazione                                                | 30/09/2026                                    |
| Codice ISIN                                                           | A : LU1861138961<br>D : LU2059756754          |
| Tipo di replica                                                       | Fisico                                        |
| Benchmark                                                             | 100% MSCI EM SRI FILTERED PAB                 |
| Tipologia dei dividendi                                               | (A) Az. ad Accumulazione<br>(D) Distribuzione |
| Data del ultimo buono                                                 | 09/12/2025 ( USD )                            |
| Ultima cedola                                                         | 1,1500 ( USD )                                |
| Forma giuridica                                                       | OICVM di diritto lussemburghese               |
| Normativa europea                                                     | OICVM                                         |
| Società di gestione                                                   | Amundi Luxembourg SA                          |
| Agente amministrativo                                                 | CACEIS Bank, Luxembourg Branch                |
| Banca depositaria                                                     | CACEIS Bank, Luxembourg Branch                |
| Revisore dei Conti                                                    | DELOITTE AUDIT                                |
| Data di lancio                                                        | 16/01/2019                                    |
| NAV alla data di istituzione                                          | 50,00 ( USD )                                 |
| Prima data di NAV                                                     | 22/01/2019                                    |
| Valuta di riferimento della classe                                    | USD                                           |
| Minimo di sottoscrizione mercato secondario                           | 1 Azione/quota                                |
| Frequenza di calcolo della quota                                      | Giornaliera                                   |
| Chiusura fiscale                                                      | Settembre                                     |

\* Per ulteriori informazioni riguardanti l'insieme dei costi sostenuti dal fondo, si prega di consultare il suo Documento contenente le Informazioni Chiave (KID). Potrebbero essere applicati costi di transazione e commissioni nel contesto della negoziazione di ETF.

## Gestore del Fondo

**Lionel Brafman**

Responsabile gestione Indice &amp; Multistrategy

**Zhicong Mou**

Gestore di portafoglio

**Arnaud Vergonjeanne**

Gestore di portafoglio supplente

## Dati dell'indice (Fonte : Amundi)

## Descrizione

L'Indice MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB è un indice azionario basato sull'Indice MSCI Emerging Markets (l'Indice principale), rappresentativo dei titoli a capitalizzazione medio-alta di 26 Paesi emergenti (aggiornato a novembre 2021). L'indice fornisce esposizione a società con eccellenti valutazioni ambientali, sociali e di governance (ESG) ed esclude le società i cui prodotti hanno un impatto sociale o ambientale negativo. Inoltre, l'indice mira a rappresentare il rendimento di una strategia che prevede la ri-ponderazione dei titoli in base alle opportunità e ai rischi associati alla transizione climatica per soddisfare i requisiti minimi del regolamento EU Paris-Aligned Benchmark (EU PAB).

## Caratteristiche (Fonte : Amundi)

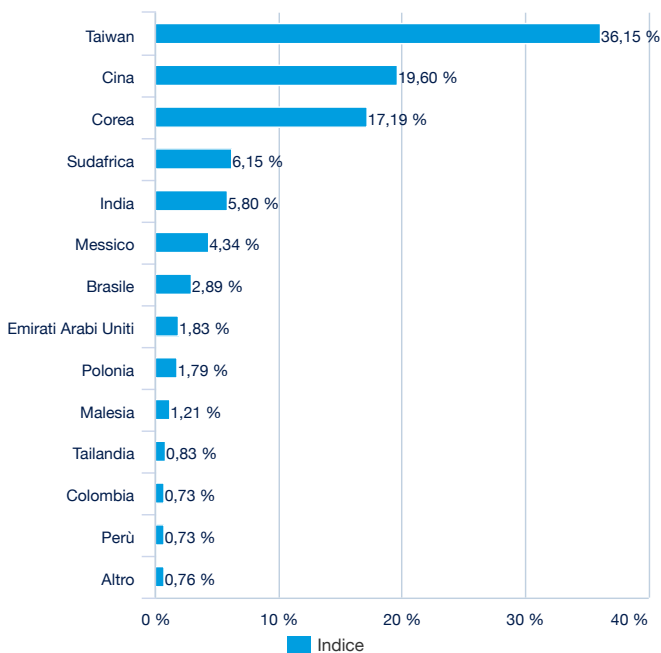
Classe di investimento : **Azionario**Esposizione : **Emergenti**Valuta di riferimento dell'indice : **USD**Numero di titoli : **140**

## Primi dieci titoli dell'indice (Fonte : Amundi)

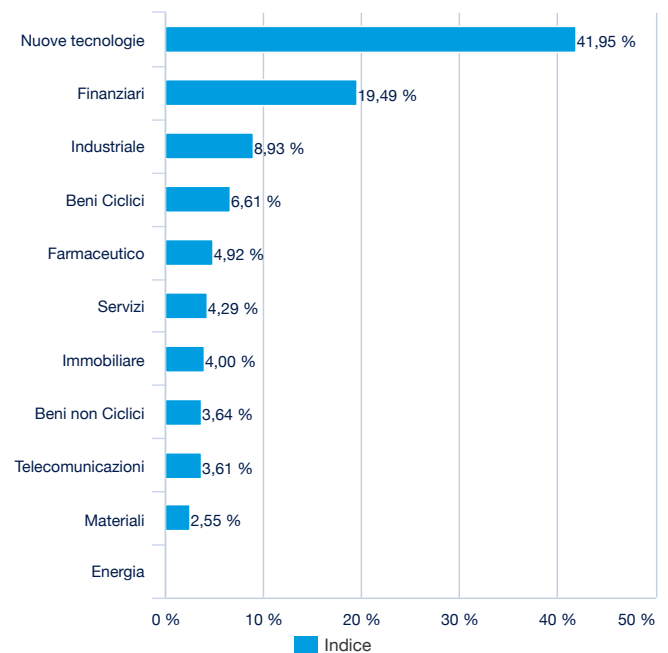
|                              | % del peso sul Benchmark |
|------------------------------|--------------------------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 15,40%                   |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 5,63%                    |
| SAMSUNG EL MECHANICS         | 5,46%                    |
| DELTA ELECTRONICS INC        | 5,04%                    |
| ASIA VITAL COMPONENTS        | 3,64%                    |
| SK SQUARE CO LTD             | 2,58%                    |
| SAMSUNG SDI CO LTD           | 2,11%                    |
| NETEASE INC                  | 2,07%                    |
| CHINA CONSTRUCT BANK         | 1,88%                    |
| NASPERS LTD-N SHS            | 1,63%                    |
| <b>Totale</b>                | <b>45,43%</b>            |

Solo a scopo illustrativo e non come raccomandazione per acquistare o vendere titoli.

## Ripartizione geografica (Fonte : Amundi)



## Ripartizione settoriale (Fonte : Amundi)





Dati di negoziazione dell'ETF (Fonte : Amundi)

| Piazza                  | Valuta | Ticker Bloomberg | INAV Bloomberg | RIC Reuters | INAV Reuters      |
|-------------------------|--------|------------------|----------------|-------------|-------------------|
| Six Swiss Exchange      | USD    | EMSRI SW         | EMSRIUIV       | EMSRI.S     | EMSRIUSDINAV=SOLA |
| Deutsche Boerse (Xetra) | EUR    | AMEI GY          | EMSRIEIV       | AMEI.DE     | EMSRIEURINAV=SOLA |
| Euronext Paris          | EUR    | EMSRI FP         | EMSRIEIV       | EMSRI.PA    | EMSRIEURINAV=SOLA |
| LSE                     | USD    | MSRU LN          | EMSRIUIV       | MSRU.L      | EMSRIUSDINAV=SOLA |
| LSE                     | GBP    | MSRG LN          | -              | MSRG.L      | -                 |
| Euronext Milan          | EUR    | EMSRI IM         | EMSRIEIV       | EMSRI.MI    | EMSRIEURINAV=SOLA |