

INFORMATIONS
SEMESTRIELLES
JUN 2023

AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

OPCVM de droit français

Société de gestion

Amundi Asset Management

Sous déléguataire de gestion comptable en titre

CACEIS Fund Administration France

Dépositaire

CACEIS BANK

Commissaire aux comptes

PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Sommaire

	Pages
Caractéristiques de l'OPC	3
Compte rendu d'activité	9
Vie de l'OPC sur l'exercice sous revue	14
Informations spécifiques	15
Attestation du commissaire aux comptes	16
Portefeuille Titres Détaillé	17

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Caractéristiques de l'OPC

Classification

Actions internationales.

Le Fonds est un fonds indiciel.

Modalité de détermination et d'affectation des sommes distribuables

Capitalisation et/ou distribution par décision de la Société de Gestion.

Régime fiscal

Le Fonds est éligible au contrat d'assurance vie. Le Fonds pourra donc servir de support de contrat d'assurance vie libellé en unités de compte.

L'OPCVM en tant que tel n'est pas sujet à imposition. Toutefois, les porteurs peuvent supporter des impositions du fait des revenus distribués par l'OPCVM, le cas échéant, ou lorsqu'ils céderont les titres de celui-ci. Le régime fiscal applicable aux sommes distribuées par l'OPCVM ou aux plus ou moins-values latentes ou réalisées par l'OPCVM dépend des dispositions fiscales applicables à la situation particulière de l'investisseur, de sa résidence fiscale et/ou de la juridiction d'investissement de l'OPCVM. Si l'investisseur n'est pas sûr de sa situation fiscale, il doit s'adresser à un conseiller fiscal ou un professionnel afin de déterminer les règles fiscales applicables à sa situation particulière, avant tout investissement. Certains revenus distribués par l'OPCVM à des non-résidents en France sont susceptibles de supporter dans cet Etat une retenue à la source.

Indicateur de référence

L'indicateur de Référence du Fonds est l'Indice STOXX® Europe 50, dividendes nets réinvestis (Total Net Return), libellé en euro.

L'indice STOXX Europe 50 est un indice « actions », calculé et publié par le fournisseur d'indices internationaux STOXX Ltd. (« STOXX »). L'Indice STOXX Europe 50 est un sous-ensemble de l'indice STOXX® 600. Il est composé des 50 valeurs les plus importantes de 18 pays européens. Les actions de l'Indice couvrent tous les secteurs économiques, et sont choisies pour leur niveau de capitalisation boursière, leur liquidité et leur poids sectoriel.

L'indice STOXX Europe 50 couvre environ 60% de la capitalisation boursière ajustée au flottant des marchés européens représentés par l'indice STOXX 600.

Frais et commissions de gestion

Frais de fonctionnement et de gestion : 0,15% TTC.

Commission de souscription acquise au Fonds : Néant.

Conformément à la réglementation et au cours de l'exercice écoulé, cet OPCVM a présenté en pratique des taux conformes à ceux mentionnés dans le prospectus et repris les rubriques :

- Annexes aux comptes annuels/- Frais de Gestion

- Capitaux propres/- Commissions de souscription et/ou rachat/- Frais de Gestion

Objectif de gestion

L'objectif de gestion du Fonds est de répliquer, le plus fidèlement possible, la performance de l'Indice STOXX Europe 50 (cf. section « Indicateur de Référence »), quelle que soit son évolution, positive ou négative.

La gestion vise à obtenir un écart entre l'évolution de la valeur liquidative du Fonds et celle de l'Indice STOXX Europe 50 (ci-après « l'Indice STOXX Europe 50 ») le plus faible possible. Ainsi, l'objectif d'écart de suivi (« tracking error ») maximal entre l'évolution de la valeur liquidative du Fonds et celle de l'Indice STOXX Europe 50 est de 2%.

Si le « tracking error » devenait malgré tout plus élevé que 2%, l'objectif serait de rester néanmoins à un niveau inférieur à 15% de la volatilité de l'Indice STOXX Europe 50.

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Stratégie d'investissement

La gestion du Fonds est de type « passive ».

1. Stratégie utilisée :

Le Fonds fait l'objet d'une gestion indicelle dont l'objectif est de répliquer les évolutions de la performance de l'Indice STOXX Europe 50 selon une méthode de réplication synthétique de l'Indice STOXX Europe 50.

Afin de rechercher la corrélation la plus élevée possible avec la performance de l'Indice STOXX Europe 50, le Fonds aura recours à l'achat d'un panier d'actions diversifié (le « Panier »), et à un contrat d'échange à terme négocié de gré à gré sur actions et indices (« total return swap ») transformant l'exposition aux titres du Panier en une exposition à l'Indice STOXX Europe 50.

Le Fonds respectera les règles d'investissements édictées aux articles R214-21, R214-22 et R214-23 du CMF.

Le Panier composé des actifs détenus directement et décrits dans la rubrique « Actifs utilisés » respecte les dispositions de l'article R214-21 du CMF.

L'exposition du Fonds à l'indice obtenue au travers du contrat d'échange à terme (« total return swap ») peut bénéficier des ratios dérogatoires applicables aux OPCVM indicels mentionnés à l'article R214-22 du CMF. Cet article dispose que l'indice peut être composé jusqu'à hauteur de 20% maximum d'actions ou de titres de créance émis par une même entité, cette limite pouvant être portée à 35% maximum pour une seule entité émettrice lorsque cela se révèle justifié par des conditions exceptionnelles sur le marché, notamment sur des marchés réglementés où certaines valeurs mobilières ou certains instruments du marché monétaire sont largement dominants.

Information sur l'intégration des risques de durabilité

La Société de Gestion applique une Politique d'Investissement Responsable qui consiste en une politique d'exclusions ciblées selon la stratégie d'investissement.

Les principales incidences négatives des décisions d'investissement (au sens du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (dit « Règlement Disclosure »)) sont les effets négatifs, importants ou susceptibles d'être importants, sur les facteurs de durabilité qui sont causés, aggravés par ou directement liés aux décisions d'investissement. L'Annexe 1 du règlement délégué au Règlement Disclosure dresse la liste des indicateurs des principales incidences négatives.

Aussi, la Société de Gestion considère la prise en compte des principales incidences négatives à travers sa politique d'exclusions normatives. En l'espèce, seul l'indicateur 14 (Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, armes à sous-munitions, armes chimiques et armes biologiques)) est pris en compte. Les autres indicateurs ainsi que la notation ESG des émetteurs ne sont pas pris en compte dans le processus d'investissement.

Des informations plus détaillées sur les principales incidences négatives sont incluses dans la déclaration réglementaire ESG de la Société de Gestion disponible sur son site internet : www.amundi.com.

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 prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

2. Actifs utilisés (hors dérivés intégrés) :

L'exposition du Fonds à l'indice est obtenue au travers du contrat d'échange à terme (« total return swap »).

Le Panier est composé des actifs décrits ci-dessous détenus directement par le Fonds.

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

- Actions :

Le Fonds sera en permanence exposé à hauteur de 60% au moins sur un marché d'actions étranger ou sur des marchés d'actions de plusieurs pays, dont éventuellement le marché français.

Le Fonds sera investi, dans le respect des ratios prévus par la réglementation, dans des actions internationales (de tous les secteurs économiques, cotées sur tous les marchés), jusqu'à 100% de son actif net dans des actions internationales. Toutefois en cas d'ajustements liés aux souscriptions/rachats, l'investissement peut dépasser de manière résiduelle cette limite.

Les actions à l'actif du Fonds seront des actions composant l'Indice STOXX Europe 50, ainsi que d'autres actions internationales, de tous les secteurs économiques, y compris les marchés de petites capitalisations. Les actions à l'actif du Fonds seront choisies afin de limiter les coûts liés à la réplification de l'Indice STOXX Europe 50.

Le fonds sera en permanence investi à hauteur de 90% au moins en actions cotées. Aux fins d'interprétation de ce ratio, les actions émises par des REITs (tel que ce terme est défini par le ministère allemand des finances) ou des OPC ne sont pas considérées comme des actions.

- Instruments de taux :

Le Fonds pourra détenir, jusqu'à 25% de son actif, des instruments financiers de type obligataire de toute nature.

Les titres en portefeuille seront sélectionnés selon le jugement de la gestion et dans le respect de la politique interne de suivi du risque de crédit de la Société de Gestion.

En vue de la sélection des titres, la gestion ne s'appuie, ni exclusivement ni mécaniquement, sur les notations émises par les agences de notation, mais fonde sa conviction d'achat et de vente d'un titre sur ses propres analyses de crédit et de marchés. A titre d'information, la gestion pourra recourir notamment à des titres bénéficiant des notations minimales lors de leur achat de BBB- dans l'échelle S&P et Moody's (notation « investment grade »).

Les émetteurs sélectionnés pourront aussi bien relever du secteur privé que du secteur public (États, collectivités territoriales, ...), les dettes privées étant susceptibles de représenter jusqu'à 100% des instruments de dette.

Les instruments obligataires étrangers seront libellés dans une des devises des Etats membres de l'OCDE.

Pour contribuer à la réalisation de son objectif de gestion et/ou gérer les flux intermédiaires, le Fonds pourra détenir, à hauteur de 10% maximum, les actifs suivants :

- Titres de créances, et instruments du marché monétaire libellés en euro :

La gestion de la trésorerie est effectuée à travers la détention d'instruments du marché monétaire.

Les titres en portefeuille seront sélectionnés selon le jugement de la gestion et dans le respect de la politique interne de suivi du risque de crédit de la Société de Gestion.

En vue de la sélection des titres, la gestion ne s'appuie, ni exclusivement ni mécaniquement, sur les notations émises par les agences de notation, mais fonde sa conviction d'achat et de vente d'un titre sur ses propres analyses de crédit et de marchés. A titre d'information, la gestion pourra recourir notamment à des titres bénéficiant des notations minimales de AA dans l'échelle S&P et Moody's.

Les émetteurs sélectionnés pourront aussi bien relever du secteur privé que du secteur public (Etats, collectivités territoriales), les dettes privées étant susceptibles de représenter jusqu'à 100% des instruments de dette. La durée moyenne de ces instruments sera inférieure à 10 ans.

- Parts ou actions d'OPCVM :

Le Fonds peut détenir jusqu'à 10% de son actif en parts et/ou actions d'OPCVM. Ces OPCVM sont représentatifs de toutes les classes d'actifs, dans le respect des contraintes du Fonds.

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Il peut s'agir d'OPCVM gérés par la Société de Gestion ou par d'autres entités appartenant ou non au Groupe Crédit Agricole SA - y compris une société liée.

3. Instruments dérivés :

Le Fonds aura recours à des instruments dérivés, notamment des instruments financiers à terme comme des total return swaps, négociés de gré à gré échangeant la valeur des actions à l'actif du Fonds contre la valeur de l'Indice STOXX Europe 50.

Le Fonds peut intervenir sur les instruments dérivés suivants :

- Nature des marchés d'intervention :

- réglementés
- organisés
- de gré à gré

- Risques sur lesquels le Fonds désire intervenir :

- action
- taux
- change
- crédit
- volatilité

- Nature des interventions, l'ensemble des opérations devant être limité à la réalisation de l'objectif de gestion :

- couverture
- exposition
- arbitrage
- trading
- autre nature

- Nature des instruments utilisés :

- futures : sur actions et indices
- options : sur actions et indices
- contrat d'échange à terme sur rendement global (« total return swap ») : sur actions et indices.

Le Fonds pourra conclure des contrats d'échange de deux combinaisons parmi les types de flux suivants :

- taux fixe
- taux variable (indexés sur l'Eonia, l'Euribor, ou toute autre référence de marché)
- performance liée à une ou plusieurs devises, actions, indices boursiers ou titres cotés, OPC ou fonds d'investissement
- dividendes (nets ou bruts)

- change à terme
- autre nature

- Stratégie d'utilisation des dérivés pour atteindre l'objectif de gestion :

- reconstitution d'une exposition synthétique à un titre, un secteur d'activité, et/ou à l'Indice STOXX Europe 50 via l'utilisation de total return swaps.
- gestion des flux intermédiaires (dividendes, souscriptions/rachats...) pour atteindre le degré d'exposition souhaité à un titre, un secteur d'activité, et/ou à l'Indice STOXX Europe 50 via l'utilisation de futures.
- gestion des flux intermédiaires (dividendes, souscriptions/rachats...) pour atteindre le degré d'exposition souhaité à un titre, un secteur d'activité, et/ou à l'Indice STOXX Europe 50 via l'utilisation d'options.

Ces instruments sont susceptibles de servir de couverture jusqu'à 100% de l'actif net du Fonds.

A titre indicatif, à la création du fonds les contrats d'échange sur rendement global (Total Return Swap) représentent environ 100% de l'actif net, ils représentent un maximum de 110% en cours de vie.

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Les actifs détenus par le Fonds et sur la performance desquels portent les contrats d'échange sur rendement global (Total Return Swap) sont conservés auprès du dépositaire.

Le contrat d'échange à terme sur rendement global ("total return swap") est tenu en position dans les livres du dépositaire.

L'engagement issu des instruments dérivés est limité à 110% de l'actif net.

4. Titres intégrant des dérivés :

Néant.

5. Dépôts et liquidités :

Le Fonds peut, dans la limite de 20% de son actif net effectuer des dépôts d'une durée maximale de douze mois. Ces dépôts contribuent à la réalisation de l'objectif de gestion du Fonds en lui permettant de gérer la trésorerie.

6. Emprunt d'espèces :

De manière exceptionnelle et temporaire, le Fonds pourra avoir recours, dans la limite de 10% de son actif net, à des emprunts, en vue d'optimiser la gestion de sa trésorerie.

7. Opérations d'acquisitions et de cessions temporaires de titres :

Néant.

Informations relatives aux garanties financières (acquisition et cession temporaires de titres) et aux contrats d'échange sur rendement global (TRS)

Nature des garanties financières :

Dans le cadre des opérations d'acquisitions et cessions temporaires de titres et des opérations sur dérivés négociés de gré à gré, le Fonds peut recevoir à titre de garantie (appelé collatéral) des titres et des espèces.

Des décotes peuvent être appliquées au collatéral reçu ; elles prennent en compte notamment la nature, la maturité, la qualité de crédit et la devise ainsi que la volatilité des prix des titres et le résultat des simulations de crises réalisées.

Les titres reçus en garantie doivent respecter des critères définis par la Société de Gestion. Ils doivent être :

- liquides,
- cessibles à tout moment,
- diversifiés dans le respect des règles d'éligibilité, d'exposition et de diversification de l'OPCVM,
- émis par un émetteur qui n'est pas une entité de la contrepartie ou de son groupe.

Pour les obligations, les titres seront en outre émis par des émetteurs localisés dans l'OCDE et de haute qualité dont la notation minimale pourrait aller de AAA à BBB- sur l'échelle de Standard & Poor's ou bénéficiant d'une notation jugée équivalente par la société de gestion. Les titres obligataires doivent avoir une échéance maximale de 50 ans.

Les critères décrits ci-dessus sont détaillés dans une politique Risques consultable sur le site internet de la Société de Gestion : www.amundi.com et pourront faire l'objet de modifications notamment en cas de circonstances de marché exceptionnelles.

Des décotes peuvent être appliquées au collatéral reçu ; elles prennent en compte la qualité de crédit, la volatilité des prix des titres ainsi que le résultat des simulations de crises réalisées.

Réutilisation du collatéral espèces reçu :

Le collatéral espèces reçu peut être réinvesti en dépôts, en obligations d'Etat, en opérations de prises en pension ou en OPCVM monétaires court terme conformément à la Politique Risques de la Société de Gestion.

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Réutilisation du collatéral titres reçu :

Non autorisé : Les titres reçus en garantie ne peuvent être vendus, réinvestis ou remis en garantie.

Description succincte de la procédure de choix des intermédiaires et commentaires éventuels

La Société de Gestion procède généralement par appel d'offres. Dans le cas présent, un appel d'offre global (contrat d'échange à terme et tenue de marché) a été effectué pour une partie de la gamme de Fonds AMUNDI ETF. De ce fait la Société de Gestion ne s'est pas engagée et ne s'engagera pas, pour ce Fonds spécifique, sur une procédure formelle, traçable et contrôlable de mise en concurrence des contreparties des instruments financiers à terme de gré-à-gré conclus, la contrepartie ayant déjà été sélectionnée à l'occasion de l'appel d'offre global. Le Fonds pourra réaliser ces opérations avec comme contreparties et intermédiaires BNP Paribas SA ou toute autre Société du groupe BNP Paribas SA.

Profil de risque

Risque actions

Risque lié aux évolutions de l'indice STOXX Europe 50

Facteurs susceptibles d'influencer la capacité du Fonds à répliquer la performance de l'Indice STOXX Europe 50

Risque de crédit

Risque de contrepartie lié au mode de réplication synthétique choisi

Risque juridique

Risque de change

Risque de liquidité

Risque de liquidité sur une place de cotation

Risque en matière de durabilité

Risque de calcul de l'Indice

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Compte rendu d'activité

L'objectif de gestion du Fonds est de répliquer, le plus fidèlement possible, la performance de l'Indice STOXX Europe 50 quelle que soit son évolution, positive ou négative. Il possède un panier d'actions et un swap de performance qui permet d'échanger la performance des actions contre la performance de l'indice STOXX Europe 50.

Sur la période sous revue du portefeuille AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF, la performance est de 11,91%. Celle du benchmark est de 11,78%.

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

Principaux mouvements dans le portefeuille au cours de l'exercice

Titres	Mouvements ("Devise de comptabilité")	
	Acquisitions	Cessions
APPLE INC	138 229 113,54	163 170 730,63
RWE AG	62 073 552,11	118 011 814,05
NVIDIA CORP	53 010 093,97	101 362 397,44
MICROSOFT CORP	67 854 914,42	85 308 309,43
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	77 031 545,91	63 534 972,12
Meta Platforms - A	51 236 515,46	50 466 510,75
SHELL PLC	47 432 550,73	51 788 230,85
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG	48 190 308,60	48 187 724,40
TEXAS INSTRUMENTS COM	52 010 099,22	43 650 723,19
BANK OF AMERICA CORP	40 934 125,95	45 286 422,61

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers - Règlement SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

a) Titres et matières premières prêtés

Montant				
% de l'Actif Net*				

*% hors trésorerie et équivalent de trésorerie

b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue

Montant					509 056 517,42
% de l'Actif Net					98,88%

c) 10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors cash) pour tous les types d'opérations de financement

--	--	--	--	--	--

d) 10 principales contreparties en valeur absolue des actifs et des passifs sans compensation

BNP PARIBAS FRANCE FRANCE					509 056 517,42
------------------------------	--	--	--	--	----------------

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash					
Rating					
Monnaie de la garantie					

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties			X	
Contrepartie centrale				
Bilatéraux	X		X	

g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour				
1 jour à 1 semaine				
1 semaine à 1 mois				
1 à 3 mois				
3 mois à 1 an				
Plus d'1 an				
Ouvertes				

h) Échéance des opérations de financement sur titres et TRS ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour				
1 jour à 1 semaine				
1 semaine à 1 mois				
1 à 3 mois				
3 mois à 1 an				509 056 517,42
Plus d'1 an				
Ouvertes				

i) Données sur la réutilisation des garanties

Montant maximal (%)				
Montant utilisé (%)				
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces en euros				

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

j) Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

Caceis Bank				
Titres				
Cash				

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Titres				
Cash				

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus				
- OPC				
- Gestionnaire				
- Tiers				
Coûts				
- OPC				
- Gestionnaire				
- Tiers				

e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

Amundi Asset Management veille à n'accepter que des titres d'une haute qualité de crédit et veille à rehausser la valeur de ses garanties en appliquant des décotes de valorisation sur les titres reçus. Ce dispositif est régulièrement revu et remis à jour.

i) Données sur la réutilisation des garanties

« La réglementation applicable aux OPCVM interdit la réutilisation par ce dernier des garanties reçues en titres. Les garanties reçues en espèces sont réinvesties dans les 5 supports suivants :

- o OPCVM monétaires court terme (tels que définis par l'ESMA dans ses orientations sur les fonds cotés et autres questions liées aux OPCVM)
- o Dépôt
- o Titres d'Etats Long Terme de haute qualité
- o Titres d'Etats Court Terme de haute qualité
- o Prises en pension »

Le montant maximal de réutilisation est de 0% pour les titres et 100% du montant reçu pour les espèces. Le montant utilisé est de 0% pour les titres et 100% pour les espèces reçus.

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Amundi Asset Management veille à travailler avec un nombre réduit de dépositaires, sélectionnés pour s'assurer de la bonne conservation des titres reçus et du cash.

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

I) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Opérations de prêts de titres et de mise en pension :

Dans le cadre des opérations de prêts de titres et de mise en pension, Amundi Asset Management a confié à Amundi Intermédiation, pour le compte de l'OPCVM, les réalisations suivantes : la sélection des contreparties, la demande de mise en place des contrats de marché, le contrôle du risque de contrepartie, le suivi qualitatif et quantitatif de la collatéralisation (contrôles de dispersion, des notations, des liquidités), des pensions et prêts de titres. Les revenus résultant de ces opérations sont restitués à l'OPCVM. Ces opérations engendrent des coûts qui sont supportés par l'OPCVM.

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Vie de l'OPC sur l'exercice sous revue

Néant.

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Informations spécifiques

Droit de vote

Conformément à la politique que la société de gestion s'est fixée et conformément au règlement du Fonds, la société de gestion exerce les droits de vote attachés aux valeurs inscrites à l'actif du Fonds et décide de l'apport des titres, à l'exception des titres de l'entreprise ou de toute entreprise qui lui est liée dans les conditions prévues à l'article L.444-3 du Code du travail.

Les documents intitulés « Politique de vote » et « Rapport d'exercice des droits de vote » élaborés par la société de gestion conformément à la réglementation sont disponibles sur demande. Le présent OPCVM n'a pas été retenu dans la liste des fonds qui votent actuellement.

Soft commissions

La société de gestion n'a pas perçu de Commissions de Mouvements.

Commission en nature

La société de gestion n'a pas perçu de Commissions en Nature.

Utilisation Dérivés de crédit

Le FCP n'a pas utilisé sur l'exercice de Dérivés de Crédit.

Fonds du groupe

Afin de prendre connaissance de l'information sur les instruments financiers détenus en portefeuille qui sont émis par la Société de Gestion ou par les entités de son groupe, veuillez-vous reporter aux rubriques des comptes annuels :

- Autres Informations.
- Instruments financiers détenus, émis et/ou gérés par le groupe.

Calcul du risque global

• Méthode de calcul du risque global : L'OPC utilise la méthode du calcul de l'engagement pour calculer le risque global de l'OPC sur les contrats financiers.



ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
Composition de l'actif au 30 juin 2023

AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF
OPCVM CONSTITUE SOUS FORME DE FONDS COMMUN DE PLACEMENT
Régi par le Code monétaire et financier

Société de gestion
AMUNDI ASSET MANAGEMENT
90, boulevard Pasteur
75015 PARIS

En notre qualité de commissaire aux comptes de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF, et en application des dispositions de l'article L.214-17 du Code monétaire et financier et de l'article 411-125 du Règlement général de l'Autorité des marchés financiers relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif au 30 juin 2023 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette mission. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Neuilly sur Seine, date de la signature électronique

Document authentifié par signature électronique

Le commissaire aux comptes
PricewaterhouseCoopers Audit
Raphaëlle Alezra-Cabessa

2023.08.11 15:27:09 +0200

PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
T: +33 (0) 1 56 57 58 59, F: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ALLIANZ SE-REG	EUR	31 329	6 679 342,80	1,29
TOTAL ALLEMAGNE			6 679 342,80	1,29
BELGIQUE				
AGEAS	EUR	123 361	4 577 926,71	0,89
TOTAL BELGIQUE			4 577 926,71	0,89
ETATS-UNIS				
ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	5	522,04	
AFC FIDELITY NALT INFORMATION SCES	USD	352 596	17 678 277,91	3,44
ALPHABET- A	USD	87 960	9 650 606,78	1,87
ALPHABET-C-	USD	43 050	4 773 380,84	0,93
AMAZON.COM INC	USD	117 735	14 067 767,74	2,73
APPLE INC	USD	190 775	33 918 081,35	6,59
AUTOZONE INC	USD	495	1 131 267,83	0,22
BLACK KNIGHT INC-WHEN ISSUED	USD	104 124	5 700 574,26	1,11
BROADCOM INC	USD	3 327	2 645 224,21	0,52
BROOKS AUTOMATION INC	USD	2	85,57	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	USD	21 040	4 522 732,17	0,88
COPART	USD	223 332	18 671 046,49	3,62
COSTCO WHOLESALE CORP	USD	1 799	887 759,51	0,17
CSX CORPORATION	USD	624 358	19 514 764,25	3,79
DXC TECHNOLOGY CO	USD	135 950	3 329 591,20	0,65
EXXON MOBIL CORP	USD	14 356	1 411 256,65	0,27
GOLDMAN SACHS GROUP	USD	15 595	4 610 459,49	0,90
HENRY (JASK) & ASSOCIATES	USD	10 405	1 595 846,61	0,31
IDEXX LABORATORIES INC	USD	9 551	4 396 699,11	0,85
INSULET CORP	USD	8 794	2 324 163,12	0,45
JOHNSON & JOHNSON	USD	26 229	3 979 307,13	0,77
KIMBERLY-CLARK CP COM	USD	132 460	16 762 078,46	3,26
KIMCO REALTY CORP	USD	39 926	721 668,85	0,14
LEAR CORP	USD	24 616	3 238 887,99	0,63
MARATHON	USD	47 718	5 099 833,91	0,99
Meta Platforms - A	USD	70 942	18 660 802,16	3,62
MICROSOFT CORP	USD	31 983	9 983 034,67	1,94
Molson Coors Beverage Co	USD	31 972	1 929 455,99	0,38
NEWMONT CORP	USD	417 567	16 327 596,90	3,17
ON SEMICONDUCTOR	USD	93 367	8 094 088,78	1,57
O REILLY AUTOMOTIVE	USD	5 444	4 766 868,19	0,93

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Portefeuille titres détaillé en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PAYPAL HOLDINGS INC	USD	104 356	6 382 837,65	1,24
PFIZER INC	USD	195 656	6 578 058,74	1,28
SP GLOBAL	USD	1 338	491 650,61	0,10
SYNOPSYS INC	USD	16 429	6 556 691,92	1,28
TESLA INC	USD	6 252	1 500 078,86	0,29
TEXAS INSTRUMENTS COM	USD	57 723	9 524 559,54	1,85
THERMO FISHER SCIEN SHS	USD	49 196	23 527 051,33	4,57
TJX COMPANIES INC	USD	64 089	4 980 849,05	0,97
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	10 873	3 507 165,38	0,68
WALGREENS BOOTS ALLIANCE	USD	148 822	3 886 286,69	0,75
WAL-MART IN COM USD0.10	USD	32 093	4 623 627,63	0,89
TOTAL ETATS-UNIS			311 952 587,56	60,60
FRANCE				
AIR LIQUIDE PRIME DE FIDELITE	EUR	42 120	6 916 104,00	1,34
L'OREAL PRIME DE FIDELITE	EUR	36 937	15 775 792,70	3,06
LVMH (LOUIS VUITTON - MOET HENNESSY)	EUR	22 237	19 190 531,00	3,73
SANOFI	EUR	44 460	4 365 972,00	0,85
TOTALENERGIES SE	EUR	187 607	9 858 747,85	1,92
TOTAL FRANCE			56 107 147,55	10,90
JAPON				
COMSYS HOLDINGS CORP	JPY	106 547	1 921 982,13	0,38
JAPAN AIR LINES	JPY	330 118	6 531 696,26	1,26
JAPAN POST HOLDING CO LTD	JPY	476 435	3 131 663,90	0,61
MITSUBISHI TOKYO FINANCIAL GROUP INC	JPY	365 414	2 467 953,49	0,48
NGK INSULATORS JPY50	JPY	444 177	4 828 020,05	0,93
OLYMPUS CORP	JPY	162 338	2 332 825,63	0,46
OSAKA GAS CO	JPY	539 200	7 548 363,00	1,47
PERSOL HOLDINGS CO LTD	JPY	444 100	7 291 468,52	1,42
ROHM COMPANY LTD	JPY	23 905	2 049 592,96	0,39
SCSK	JPY	95 809	1 372 842,88	0,27
SMC CORP	JPY	14 488	7 302 448,07	1,42
SOFTBANK CORP	JPY	196 481	1 918 860,76	0,37
SONY GROUP CORPORATION.	JPY	100 422	8 256 644,18	1,60
SUMITOMO METAL MNG JPY50	JPY	74 663	2 192 716,06	0,43
SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS	JPY	29 968	971 707,90	0,19
YAKULT HONSHA CO LTD	JPY	115 600	6 674 826,25	1,30
TOTAL JAPON			66 793 612,04	12,98
PAYS-BAS				
ABN AMRO BANK NV-CVA	EUR	249 869	3 555 635,87	0,69
EXOR NV	EUR	196 641	16 061 636,88	3,12
ING GROEP NV	EUR	122 578	1 512 367,36	0,29

OPCVM AMUNDI ETF STOXX EUROPE 50 UCITS ETF

Portefeuille titres détaillé en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
QIAGEN N.V.	USD	1 174	48 455,75	0,01
TOTAL PAYS-BAS			21 178 095,86	4,11
ROYAUME-UNI				
SHELL PLC	EUR	478 713	13 210 085,24	2,57
TOTAL ROYAUME-UNI			13 210 085,24	2,57
SUISSE				
ABB LTD	CHF	184 971	6 666 953,31	1,30
LONZA GROUP NOM.	CHF	6 255	3 418 284,92	0,66
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	CHF	56 802	15 916 548,33	3,09
THE SWATCH GROUP AG-B	CHF	30 000	8 025 203,63	1,56
TOTAL SUISSE			34 026 990,19	6,61
TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			514 525 787,95	99,95
TOTAL Actions et valeurs assimilées			514 525 787,95	99,95
Instrument financier à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps TRS				
BNP	EUR	509 056 517,42	469 857,64	0,09
TOTAL Swaps TRS			469 857,64	0,09
TOTAL Autres instruments financiers à terme			469 857,64	0,09
TOTAL Instrument financier à terme			469 857,64	0,09
Créances			1 414 926,94	0,27
Dettes			-1 659 098,36	-0,32
Comptes financiers			45 561,99	0,01
Actif net			514 797 036,16	100,00

Amundi Asset Management, Société par actions Simplifiée - SAS au capital de 1 143 615 555 €.
Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 04 000 036.
Sièges social : 91-93 boulevard Pasteur - 75015 Paris - France - 437 574 452 RCS Paris - www.amundi.com

Amundi
ASSET MANAGEMENT