

AMUNDI INDEX SOLUTIONS

DOCUMENTO PER LA QUOTAZIONE

Ammissione alle negoziazioni delle azioni dei seguenti comparti di Amundi Index Solutions, società di investimento a capitale variabile di tipo aperto di diritto lussemburghese, multi-comparto, con responsabilità segregata tra i comparti, gestita da Amundi Luxembourg S.A., con sede legale in 5, allée Scheffer, L-2520 Lussemburgo, costituita ed operante in conformità alla Direttiva 2009/65/CE, come attuata dalle Direttive 2010/42/CE e 2010/43/CE e successive modifiche (la "SICAV").

Comparto	Classe di azioni	ISIN
AMUNDI MSCI EM ASIA	AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF - EUR (C)	LU1681044480
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF - EUR (C)	LU1681045024
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD UCITS ETF DR - EUR (C)	LU1681042609
AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR	AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR UCITS ETF - EUR (C)	LU1681041890
AMUNDI MSCI NORDIC	AMUNDI MSCI NORDIC UCITS ETF - EUR (C)	LU1681044647
AMUNDI RUSSELL 2000	AMUNDI RUSSELL 2000 UCITS ETF - EUR (C)	LU1681038672
AMUNDI S&P 500	AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - EUR (C)	LU1681048804
AMUNDI S&P 500	AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR (C)	LU1681049109

Data di deposito in CONSOB della Copertina: 15 marzo 2018

Data di validità della Copertina: 22 marzo 2018

Ultimo aggiornamento del Documento di Quotazione: 22 marzo 2024

La pubblicazione del presente Documento per la Quotazione non comporta alcun giudizio della CONSOB sull'opportunità dell'investimento proposto. Il presente Documento per la Quotazione è parte integrante e necessaria del Prospetto della SICAV.

DOCUMENTO PER LA QUOTAZIONE

Relativo al Comparto

Comparto	Classe di azioni	ISIN
AMUNDI MSCI EM ASIA	AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF - EUR (C)	LU1681044480
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF - EUR (C)	LU1681045024
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD UCITS ETF DR - EUR (C)	LU1681042609
AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR	AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR UCITS ETF - EUR (C)	LU1681041890
AMUNDI MSCI NORDIC	AMUNDI MSCI NORDIC UCITS ETF - EUR (C)	LU1681044647
AMUNDI RUSSELL 2000	AMUNDI RUSSELL 2000 UCITS ETF - EUR (C)	LU1681038672
AMUNDI S&P 500	AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - EUR (C)	LU1681048804
AMUNDI S&P 500	AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR (C)	LU1681049109

avente le caratteristiche di ETF a gestione passiva di diritto lussemburghese

Soggetto incaricato della gestione: Amundi Luxembourg S.A.

Data di deposito in CONSOB del presente Documento per la Quotazione: 15 marzo 2018

Data di validità del presente Documento per la Quotazione: 22 marzo 2018

Ultimo aggiornamento del Documento di Quotazione: 22 marzo 2024

(A.) INFORMAZIONI GENERALI RELATIVE ALL'AMMISSIONE ALLE NEGOZIAZIONI

1. PREMESSA E DESCRIZIONE SINTETICA DELL'OICR

La SICAV è una società di investimento a capitale variabile di tipo aperto di diritto lussemburghese, multi-comparto, con responsabilità segregata tra i comparti e sede legale in 5, Allée Scheffer, L-2520 Lussemburgo, ed è qualificata come organismo d'investimento collettivo in valori mobiliari ("OICVM") armonizzato ai sensi della Direttiva 2009/65/CE, come attuata dalle Direttive 2010/42/CE e 2010/43/CE e successive modifiche.

La SICAV è gestita da Amundi Luxembourg S.A. con sede legale in 5, Allée Scheffer, L-2520 Lussemburgo (la "**Società di Gestione**").

La SICAV offre in sottoscrizione le azioni (le "**Azioni**" o, singolarmente, la "**Azione**") dei propri comparti (ciascuno un "**Comparto**" o un "**Fondo**" e collettivamente i "**Comparti**" o i "**Fondi**") attraverso la quotazione e la negoziazione su mercati regolamentati. I Fondi sono denominati anche Exchange-Traded Funds (o, in breve, "**ETF**").

Gli investitori qualificati, come definiti ai sensi dell'articolo 34-ter, comma 1 del Regolamento CONSOB n. 11971 del 14 maggio 1999 ("**Regolamento Emittenti**") e successive modificazioni ed integrazioni, avranno la possibilità di acquistare le Azioni dell'ETF in sede di prima emissione direttamente dall'emittente ovvero di riscattare successivamente presso l'emittente le stesse Azioni. Gli investitori privati potranno acquistare o vendere in qualsiasi momento le Azioni dell'ETF esclusivamente sul Mercato Secondario avvalendosi di Intermediari Abilitati.

1.1 AMUNDI MSCI EM ASIA

AMUNDI MSCI EM ASIA ha come obiettivo di gestione quello di replicare il rendimento dell'indice MSCI Emerging Markets Asia e minimizzare il *tracking error* tra il valore patrimoniale netto del Comparto e il rendimento dell'Indice. Il Fondo mira a conseguire un livello di *tracking error* normalmente non superiore all'1%.

Il Fondo è oggetto di una gestione di tipo "indicizzato" il cui obiettivo è replicare le evoluzioni della performance dell'indice MSCI Emerging Markets Asia secondo un metodo di replica sintetica, attraverso un *total return swap* (strumento finanziario derivato) che trasforma l'esposizione ai titoli detenuti in un'esposizione all'indice MSCI Emerging Markets Asia. In dettaglio, la variazione di valore dell'Indice di Riferimento è oggetto di *swap* da una controparte al Comparto e, in cambio, il rendimento dei titoli detenuti dal comparto è oggetto di *swap* dal Comparto alla medesima controparte, in modo che il rendimento del Comparto rifletta la variazione dell'Indice senza risentire del rendimento dei titoli che il Comparto ha in portafoglio.

La controparte del *total return swap* è una primaria istituzione finanziaria specializzata in questo tipo di operazioni. Gli strumenti derivati costituiscono parte integrante delle strategie d'investimento del Fondo.

Il periodo minimo raccomandato per la detenzione delle Azioni è 5 anni.

L'Indice MSCI Emerging Markets Asia è un indice azionario rappresentativo dei mercati a capitalizzazione medio-alta dei paesi emergenti asiatici (secondo la metodologia dell'indice).

L'indice è di tipo *net total return* (cioè i dividendi al netto di imposta corrisposti dagli elementi costitutivi dell'indice sono inclusi nel rendimento dell'indice stesso) ed è denominato in Dollari Statunitensi.

L'indice MSCI Emerging Markets Asia è ri-bilanciato su base trimestrale. La metodologia, la composizione, la revisione dell'indice MSCI Emerging Markets Asia nonché il metodo di calcolo sono disponibili sul sito internet: msci.com.

Il codice ISIN dell'ETF è: LU1681044480. La valuta della Classe di Azioni è l'Euro.

Il valore dell'indice MSCI Emerging Markets Asia è calcolato e pubblicato in tempo reale. Il codice identificativo dell'indice è: .dMIMS00000NUS su Reuters e NDUEEGFA su Bloomberg.

Per maggiori informazioni, gli investitori sono invitati a consultare il Prospetto della SICAV nella sezione relativa al Fondo (il “**Prospetto**”).

1.2 AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA

AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA ha come obiettivo di gestione quello di replicare il rendimento dell'Indice MSCI Emerging Markets Latam e minimizzare il *tracking error* tra il valore patrimoniale netto del Comparto e il rendimento dell'Indice. Il Fondo mira a conseguire un livello di *tracking error* normalmente non superiore all'1%.

Il Fondo è oggetto di una gestione di tipo "indicizzato" il cui obiettivo è replicare le evoluzioni della performance dell'indice MSCI Emerging Markets Latam secondo un metodo di replica sintetica, attraverso un *total return swap* (strumento finanziario derivato) che trasforma l'esposizione ai titoli detenuti in un'esposizione all'indice MSCI Emerging Markets Latam. In dettaglio, la variazione di valore dell'Indice di Riferimento è oggetto di swap da una controparte al Comparto e, in cambio, il rendimento dei titoli detenuti dal comparto è oggetto di *swap* dal Comparto alla medesima controparte, in modo che il rendimento del Comparto rifletta la variazione dell'Indice senza risentire del rendimento dei titoli che il Comparto ha in portafoglio. La controparte del *total return swap* è una primaria istituzione finanziaria specializzata in questo tipo di operazioni. Gli strumenti derivati costituiscono parte integrante delle strategie d'investimento del Fondo.

Il periodo minimo raccomandato per la detenzione delle Azioni è 5 anni.

L'indice è di tipo *net total return* (cioè i dividendi al netto di imposta corrisposti dagli elementi costitutivi dell'indice sono inclusi nel rendimento dell'indice stesso) ed è denominato in Dollari Statunitensi.

L'Indice MSCI Emerging Markets Latam è un indice azionario rappresentativo dei mercati a capitalizzazione medio-alta dei paesi emergenti dell'America Latina (secondo la metodologia dell'indice).

L'indice MSCI Emerging Markets Latam è ri-bilanciato su base trimestrale. La metodologia, la composizione, la revisione dell'indice MSCI Emerging Markets Latam nonché il metodo di calcolo sono disponibili sul sito internet msci.com.

Il codice ISIN dell'ETF è: LU1681045024. La valuta della Classe di Azioni è l'Euro.

Il valore dell'indice MSCI Emerging Markets Latam è calcolato e pubblicato in tempo. Il codice identificativo dell'indice è: .dMILA00000NUS su Reuters e NDUEEGFL su Bloomberg.

Per maggiori informazioni, gli investitori sono invitati a consultare il Prospetto della SICAV nella sezione relativa al Fondo (il "Prospetto").

1.3 AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB ha come obiettivo di gestione quello di replicare il rendimento dell'Indice MSCI Europe e minimizzare *il tracking error* tra il valore patrimoniale netto del Comparto e il rendimento dell'Indice. Il Fondo mira a conseguire un livello di *tracking error* normalmente non superiore all'1%.

Il Fondo è oggetto di una gestione di tipo "indicizzato" il cui obiettivo è replicare le evoluzioni della performance dell'indice MSCI Europe secondo un metodo di replica sintetica, attraverso un *total return swap* (strumento finanziario derivato) che trasforma l'esposizione ai titoli detenuti in un'esposizione all'indice MSCI Europe. In dettaglio, la variazione di valore dell'Indice di Riferimento è oggetto di *swap* da una controparte al Comparto e, in cambio, il rendimento dei titoli detenuti dal comparto è oggetto di *swap* dal Comparto alla medesima controparte, in modo che il rendimento del Comparto rifletta la variazione dell'Indice senza risentire del rendimento dei titoli che il Comparto ha in portafoglio. La controparte del *total return swap* è una primaria istituzione finanziaria specializzata in questo tipo di operazioni. Gli strumenti derivati costituiscono parte integrante delle strategie d'investimento del Fondo.

Il periodo minimo raccomandato per la detenzione delle Azioni è 5 anni.

L'Indice MSCI Europe è un indice azionario rappresentativo dei mercati a capitalizzazione medio-alta dei paesi sviluppati europei (secondo la metodologia dell'indice).

L'indice è di tipo *net total return* (cioè i dividendi al netto di imposta corrisposti dagli elementi costitutivi dell'indice sono inclusi nel rendimento dell'indice stesso) ed è denominato in Euro.

L'indice MSCI Europe è ri-bilanciato su base trimestrale. La metodologia, la composizione, la revisione dell'indice MSCI Europe nonché il metodo di calcolo sono disponibili sul sito internet msci.com.

Il codice ISIN dell'ETF è: LU1681042609. La valuta della Classe di Azioni è l'Euro.

Il valore dell'indice MSCI Europe è calcolato e pubblicato in tempo reale. Il codice identificativo dell'indice è: MXEUEBSL su Bloomberg.

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, fra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'Articolo 8 del Regolamento SFDR.

Per maggiori informazioni, gli investitori sono invitati a consultare il Prospetto della SICAV nella sezione relativa al Fondo (il "Prospetto").

1.4 AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR

AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR ha come obiettivo di gestione quello di replicare il rendimento dell'Indice MSCI Europe Quality e minimizzare il *tracking error* tra il valore patrimoniale netto del Comparto e il rendimento dell'Indice. Il Fondo mira a conseguire un livello di *tracking error* normalmente non superiore all'1%.

Il Fondo è oggetto di una gestione di tipo "indicizzato" il cui obiettivo è replicare le evoluzioni della performance dell'indice MSCI Europe Quality secondo un metodo di replica sintetica, attraverso un *total return swap* (strumento finanziario derivato) che trasforma l'esposizione ai titoli detenuti in un'esposizione all'indice MSCI Europe Quality. In dettaglio, la variazione di valore dell'Indice di Riferimento è oggetto di *swap* da una controparte al Comparto e, in cambio, il rendimento dei titoli detenuti dal comparto è oggetto di *swap* dal Comparto alla medesima controparte, in modo che il rendimento del Comparto rifletta la variazione dell'Indice senza risentire del rendimento dei titoli che il Comparto ha in portafoglio. La controparte del *total return swap* è una primaria istituzione finanziaria specializzata in questo tipo di operazioni. Gli strumenti derivati costituiscono parte integrante delle strategie d'investimento del Fondo.

Il periodo minimo raccomandato per la detenzione delle Azioni è 5 anni.

L'Indice MSCI Europe Quality è un indice azionario composto da titoli negoziati sui principali mercati azionari dei paesi europei sviluppati (secondo la metodologia dell'indice) con un potenziale di crescita di qualità a lungo termine.

L'indice è di tipo *net total return* (cioè i dividendi al netto di imposta corrisposti dagli elementi costitutivi dell'indice sono inclusi nel rendimento dell'Indice stesso) ed è denominato in Euro.

L'indice MSCI Europe Quality è ri-bilanciato su base semestrale. La metodologia, la composizione, la revisione dell'indice MSCI Europe Quality e il metodo di calcolo sono disponibili sul sito internet msci.com.

Il codice ISIN dell'ETF è: LU1681041890. La valuta della Classe di Azioni è l'Euro.

Il valore dell'indice MSCI Europe Quality è calcolato e pubblicato in tempo reale. Il codice identificativo dell'indice è: M7EUQU su Bloomberg.

Per maggiori informazioni, gli investitori sono invitati a consultare il Prospetto della SICAV nella sezione relativa al Fondo (il "Prospetto").

1.5 AMUNDI MSCI NORDIC

AMUNDI MSCI NORDIC ha come obiettivo di gestione quello di replicare il rendimento dell'Indice MSCI Nordic Countries e minimizzare il *tracking error* tra il valore patrimoniale netto del Comparto e il rendimento dell'Indice. Il Fondo mira a conseguire un livello di *tracking error* normalmente non superiore all'1%.

Il Fondo è oggetto di una gestione di tipo "indicizzato" il cui obiettivo è replicare le evoluzioni della performance dell'indice MSCI Nordic Countries secondo un metodo di replica sintetica, attraverso un *total return swap* (strumento finanziario derivato) che trasforma l'esposizione ai titoli detenuti in un'esposizione all'indice MSCI Nordic Countries. In dettaglio, la variazione di valore dell'Indice di

Riferimento è oggetto di *swap* da una controparte al Comparto e, in cambio, il rendimento dei titoli detenuti dal comparto è oggetto di *swap* dal Comparto alla medesima controparte, in modo che il rendimento del Comparto rifletta la variazione dell'Indice senza risentire del rendimento dei titoli che il Comparto ha in portafoglio. La controparte del *total return swap* è una primaria istituzione finanziaria specializzata in questo tipo di operazioni. Gli strumenti derivati costituiscono parte integrante delle strategie d'investimento del Fondo.

Il periodo minimo raccomandato per la detenzione delle Azioni è 5 anni.

L'Indice MSCI Nordic Countries è un indice azionario rappresentativo dei principali titoli negoziati sui mercati nordici (Danimarca, Finlandia, Norvegia e Svezia).

L'indice è di tipo *net total return* (cioè i dividendi al netto di imposta corrisposti dagli elementi costitutivi dell'indice sono inclusi nel rendimento dell'Indice stesso) ed è denominato in Euro.

L'indice MSCI Nordic Countries è ri-bilanciato su base trimestrale. La metodologia, la composizione, la revisione dell'indice MSCI Nordic Countries e il metodo di calcolo sono disponibili sul sito internet msci.com.

Il codice ISIN dell'ETF è: LU1681044647. La valuta della Classe di Azioni è l'Euro.

Il valore dell'indice MSCI Nordic Countries è calcolato e pubblicato in tempo reale. Il codice identificativo dell'indice è: MSDENCN su Bloomberg.

Per maggiori informazioni, gli investitori sono invitati a consultare il Prospetto della SICAV nella sezione relativa al Fondo (il "Prospetto").

1.6 AMUNDI RUSSELL 2000

AMUNDI RUSSELL 2000 ha come obiettivo di gestione quello di replicare il rendimento dell'Indice Russell 2000 e minimizzare il *tracking error* tra il valore patrimoniale netto del Comparto e il rendimento dell'Indice. Il Fondo mira a conseguire un livello di *tracking error* normalmente non superiore all'1%.

Il Fondo è oggetto di una gestione di tipo "indicizzato" il cui obiettivo è replicare le evoluzioni della performance dell'indice Russell 2000 secondo un metodo di replica sintetica, attraverso un *total return swap* (strumento finanziario derivato) che trasforma l'esposizione ai titoli detenuti in un'esposizione all'indice Russell 2000. In dettaglio, la variazione di valore dell'Indice di Riferimento è oggetto di *swap* da una controparte al Comparto e, in cambio, il rendimento dei titoli detenuti dal comparto è oggetto di *swap* dal Comparto alla medesima controparte, in modo che il rendimento del Comparto rifletta la variazione dell'Indice senza risentire del rendimento dei titoli che il Comparto ha in portafoglio. La controparte del *total return swap* è una primaria istituzione finanziaria specializzata in questo tipo di operazioni. Gli strumenti derivati costituiscono parte integrante delle strategie d'investimento del Fondo.

Il periodo minimo raccomandato per la detenzione delle Azioni è 5 anni.

L'Indice Russell 2000 è un indice azionario rappresentativo dei 2.000 titoli a piccola capitalizzazione negoziati sul mercato statunitense. L'indice Russell 2000 è una sottocategoria dell'indice Russell 3000 che copre il 99% circa di tutta la capitalizzazione di borsa del mercato statunitense.

Sono esclusi dall'indice Russell 3000 e, pertanto, anche dai suoi sub-indici:

- i titoli la cui capitalizzazione di borsa sia inferiore a 30 milioni di Dollari Statunitensi;
- i titoli negoziati al di sotto di 1 Dollaro Statunitense;
- i titoli negoziati sul mercato "Pink Quote" o sul "Bulletin Board";
- i fondi chiusi, le "limited partnership", i "Royalty trust", ecc.;
- i "Foreign Stocks and American Depositary Receipt" (ADR);
- i REIT (Fondi d'investimento immobiliari) e le PTP quotati in borsa.

L'indice è di tipo *net total return* (cioè i dividendi al netto di imposta corrisposti dagli elementi costitutivi dell'indice sono inclusi nel rendimento dell'Indice stesso) ed è denominato in Dollari Statunitensi.

L'indice Russell 2000 è ri-bilanciato su base annuale. Il codice ISIN dell'ETF è: LU1681038672. La valuta della Classe di Azioni è l'Euro.

La metodologia, la composizione, la revisione dell'indice Russell 2000 e il metodo di calcolo sono disponibili sul sito internet ftse.com.

Il valore dell'indice Russell 2000 è calcolato e pubblicato in tempo reale. Il codice identificativo dell'indice è: .RUTNU su Reuters e RU20N30U su Bloomberg.

Per maggiori informazioni, gli investitori sono invitati a consultare il Prospetto della SICAV nella sezione relativa al Fondo (il "Prospetto").

1.7 AMUNDI S&P 500

AMUNDI S&P 500 ha come obiettivo di gestione quello di replicare il rendimento dell'Indice S&P 500 e minimizzare il *tracking error* tra il valore patrimoniale netto del Comparto e il rendimento dell'Indice. Il Fondo mira a conseguire un livello di *tracking error* normalmente non superiore all'1%.

Il Fondo è oggetto di una gestione di tipo "indicizzato" il cui obiettivo è replicare le evoluzioni della performance dell'indice dell'Indice S&P 500 secondo un metodo di replica sintetica, attraverso un *total return swap* (strumento finanziario derivato) che trasforma l'esposizione ai titoli detenuti in un'esposizione all'indice dell'Indice S&P 500. In dettaglio, la variazione di valore dell'Indice di Riferimento è oggetto di *swap* da una controparte al Comparto e, in cambio, il rendimento dei titoli detenuti dal comparto è oggetto di *swap* dal Comparto alla medesima controparte, in modo che il rendimento del Comparto rifletta la variazione dell'Indice senza risentire del rendimento dei titoli che il Comparto ha in portafoglio. La controparte del *total return swap* è una primaria istituzione finanziaria specializzata in questo tipo di operazioni. Gli strumenti derivati costituiscono parte integrante delle strategie d'investimento del Fondo.

Il periodo minimo raccomandato per la detenzione delle Azioni è 5 anni.

L'Indice S&P500 è un indice azionario rappresentativo dei 500 principali titoli per capitalizzazione di mercato negoziati negli Stati Uniti.

L'indice è di tipo *net total return* (cioè i dividendi al netto di imposta corrisposti dagli elementi costitutivi dell'indice sono inclusi nel rendimento dell'Indice stesso) ed è denominato in Dollari Statunitensi.

Con riferimento al mercato italiano, il Fondo prevede, attualmente, la possibilità di sottoscrivere e quotare le azioni di Classe EUR e le azioni di Classe Daily Hedged EUR, entrambe oggetto del presente Documento per la Quotazione.

Il codice ISIN dell'ETF delle azioni di classe EUR è: LU1681048804. Il codice ISIN delle azioni di Classe Daily Hedged EUR LU1681049109. La valuta delle Classi di Azioni è l'Euro.

La metodologia, la composizione, la revisione dell'indice S&P500 e il metodo di calcolo sono disponibili sul sito internet ftse.com.

Il valore dell'indice S&P500 è calcolato e pubblicato in tempo reale. Il codice identificativo dell'indice è: .SPXNTR su Reuters e SPTR500N su Bloomberg.

Per maggiori informazioni, gli investitori sono invitati a consultare il Prospetto della SICAV nella sezione relativa al Fondo (il "Prospetto").

2. RISCHI

Nei seguenti paragrafi sono individuati, in via generale e non esaustiva, alcuni rischi connessi all'investimento nelle Azioni dei Fondi.

Prima di procedere all'investimento nelle Azioni dei Fondi si invitano i potenziali investitori a leggere la sezione "Descrizione dei Rischi" ("*Risk Descriptions*") del Prospetto e il presente Documento per la Quotazione.

2.1 Rischio di investimento

Non vi è alcuna garanzia che l'obiettivo di gestione dei Fondi possa essere raggiunto né che le Azioni negoziate riflettano la performance dell'indice di riferimento. Infatti, potrebbe non rendersi sempre possibile una perfetta replica dell'Indice di riferimento a causa, a titolo esemplificativo ma non esaustivo, dei seguenti fattori:

- I Comparti devono sostenere spese di vario genere, mentre i rispettivi Indici non risentono di alcuna spesa;
- I Comparti sono tenuti a rispettare limiti di investimento che non incidono sulla formazione dei rispettivi Indici;
- L'esistenza, nell'ambito del Comparto, di attività non investite;
- Le differenti tempistiche con cui l'Indice e i Comparti riflettono la distribuzione dei dividendi.

Ne consegue l'impossibilità di garantire che il Valore Patrimoniale Netto per Azione ("NAV") o il prezzo di negoziazione riproducano perfettamente la performance registrata dall'Indice di riferimento.

Il valore delle azioni negoziate può non riflettere la performance dell'Indice.

Il valore delle operazioni associate agli swap può variare in base a vari fattori quali, a titolo esemplificativo, il livello dell'indice, il livello dei tassi di interesse e la liquidità del mercato.

2.2 Rischio indice

Non vi è garanzia che l'indice di riferimento dei Fondi continui ad essere calcolato e pubblicato in via

continuativa. In particolare, potrebbero verificarsi casi di sospensione o interruzione temporanea che non consentano di riequilibrare la composizione del portafoglio dei titoli componenti l'indice di riferimento. In tali circostanze, e, comunque, in ogni caso in cui l'indice di riferimento cessi di essere calcolato o pubblicato, l'investitore avrà diritto di ottenere il rimborso delle proprie Azioni a valere sul patrimonio dei Fondi, con le modalità indicate nella sezione "Rimborso delle Azioni" ("Redeeming Shares") del Prospetto della SICAV.

2.3 Rischio di sospensione temporanea della valorizzazione delle Azioni

Il Prospetto della SICAV illustra i criteri e le modalità di calcolo del valore patrimoniale netto ("NAV") delle Azioni. Si prega di consultare la sezione "Come viene calcolato il NAV" ("*How we calculate NAV*") del Prospetto della SICAV.

Nel Prospetto sono inoltre indicati i casi in cui la Società di Gestione può momentaneamente sospendere il calcolo del NAV, la sottoscrizione, la conversione e il rimborso delle Azioni. Si prega di consultare la sezione "Diritti a Noi Riservati" ("*Rights We Reserve*") del Prospetto della SICAV.

L'insieme delle Azioni può essere riacquistato dalla Società di Gestione.

2.4 Rischio di liquidazione anticipata

I Fondi possono essere soggetti a liquidazione anticipata. Al verificarsi di tali ipotesi, l'investitore potrebbe ricevere un corrispettivo per le Azioni detenute inferiore a quello che avrebbe ottenuto se avesse avuto la possibilità di decidere autonomamente quando vendere le Azioni.

Si prega di consultare la sezione "Liquidazione o Fusione" ("*Liquidation or Merger*") del Prospetto della SICAV.

2.5 Rischio di cambio

La valuta di trattazione delle Azioni dei Comparti sul Mercato Secondario è l'Euro, mentre gli investimenti dei Comparti AMUNDI S&P 500, AMUNDI RUSSELL 2000, AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA e AMUNDI MSCI EM ASIA sono denominati anche in valute diverse, sulla base dei titoli che compongono il relativo indice. Pertanto, l'investitore è esposto alle variazioni del tasso di cambio tra l'Euro e le valute dei titoli che compongono gli Indici rilevanti.

Relativamente alla Classe Daily Hedged EUR del comparto AMUNDI S&P 500, l'indice di riferimento è S&P 500, denominato in Dollari Statunitensi. La copertura del rischio di cambio Euro/Yen e Euro/ Dollari Statunitensi è realizzata tramite contratti a termine (*forward*) rettificati su base giornaliera. In tal modo, gli investitori non sono esposti al rischio di cambio tra la valuta delle azioni che rientrano nella composizione dell'indice S&P500 e la valuta della Classe Daily Hedged EUR.

2.6 Rischio di controparte

Per raggiungere il suo obiettivo di gestione, il Fondo farà ricorso a strumenti finanziari a termine (in particolare *total return swap*) negoziati fuori dai mercati regolamentati. Il Fondo sarà esposto al rischio di controparte risultante dall'utilizzo di strumenti finanziari a termine conclusi con un istituto di credito. Il Fondo è quindi esposto al rischio che questo istituto di credito non possa onorare i suoi impegni relativi a tali strumenti. L'inadempienza della controparte dello swap (o di qualsiasi altro emittente) potrà avere un effetto negativo sul valore patrimoniale netto del Fondo.

Le azioni possono essere acquistate da tutti gli investitori sul mercato di quotazione - indicato nel paragrafo successivo - attraverso intermediari abilitati ("**Intermediari Abilitati**"). Restano fermi per questi ultimi gli obblighi di rendicontazione di cui agli articoli 49 e 53 del Regolamento CONSOB n. 20307 del 2018 (il "**Regolamento Intermediari**").

3. AVVIO DELLE NEGOZIAZIONI

Con provvedimento n. LOL-003848 del 9 marzo 2018, Borsa Italiana S.p.A. ha disposto la quotazione delle Azioni dei Fondi sul Mercato *ETFplus*, segmento *ETF indicizzati - classe 2*", (come dettagliato nel successivo paragrafo 4.1 del presente Documento per la Quotazione). La data di inizio negoziazioni sarà comunicata con successivo Avviso.

4. NEGOZIABILITÀ DELLE AZIONI E INFORMAZIONI SULLE MODALITÀ DI RIMBORSO

4.1 MODALITÀ DI NEGOZIAZIONE

Le Azioni potranno essere acquistate o vendute, in Italia, esclusivamente sul Mercato *ETFplus* avvalendosi di Intermediari Abilitati. La negoziazione delle Quote sul Mercato *ETFplus*, segmento *ETF indicizzati - classe 1*, si svolgerà secondo i seguenti orari:

- dalle ore 07.30 alle ore 09.04 ora italiana (asta di apertura);
- dalle ore 09.04 alle 17.30 ora italiana (negoziazione continua);
- dalle ore 17:30 alle ore 17:35 (asta di chiusura) e
- dalle ore 17:35 alle ore 17:40 in *Trading-at-last*.

La negoziazione si svolge con l'intervento dell'operatore "*Market Maker*" (come di seguito definito) il quale si impegna a sostenere la liquidità delle Azioni. L'operatore *Market Maker* dovrà, inoltre, esporre, in via continuativa, proposte in acquisto e in vendita a prezzi che non si discostino tra loro della percentuale massima stabilita da Borsa Italiana S.p.A. Quest'ultima ha stabilito, inoltre, il quantitativo minimo di ciascuna proposta e le modalità e i tempi di immissione delle suddette proposte.

L'Intermediario Abilitato provvederà ad inviare all'investitore una conferma dell'operazione d'acquisto e di vendita, contenente tutti i dati che consentano un'idonea identificazione dell'operazione stessa.

Le Azioni acquistate sul mercato secondario non possono di regola essere rimborsate a valore sul patrimonio del Fondo salvo che non ricorrano le situazioni indicate nel Prospetto della SICAV. Si prega di consultare il paragrafo "Procedura di acquisto e vendita sul mercato secondario" ("*Purchase and sale procedure on the secondary market*") della sezione "Mercato Secondario per le Classi di Azioni di ETF OICVM" ("*Secondary Market For Ucits Etf Shares Classes*").

Si precisa che ai sensi dell'articolo 19-*quater* del Regolamento Emittenti, gli investitori potranno richiedere il rimborso delle loro Azioni anche a valore sul patrimonio del Fondo ove il valore di quotazione presenti uno scostamento significativo dal valore unitario della quota. Si fa tuttavia presente che il Prospetto del Fondo specifica le commissioni di rimborso applicabili. Si prega di consultare la sezione del Prospetto della SICAV relativa al Fondo.

4.2 OBBLIGHI INFORMATIVI

La Società di Gestione assicura che:

- la composizione del patrimonio netto di ciascun Fondo sia disponibile e regolarmente aggiornata sul sito internet www.amundiETF.com;

- il valore dell'indicatore di riferimento del Fondo sia disponibile sugli *information providers* Reuters e Bloomberg;
- il valore dell'iNAV delle Azioni sia disponibile sugli *information providers* Reuters e Bloomberg.

La Società di Gestione informa senza indugio il pubblico dei fatti riguardanti i Fondi che non siano di pubblico dominio e idonei, se resi pubblici, a influenzare sensibilmente il prezzo delle Azioni, mediante invio del comunicato di cui all'art. 66 del Regolamento Emittenti.

4.3 ALTRI MERCATI IN CUI SONO NEGOZiate LE AZIONI

Nella tabella che segue sono elencati gli altri mercati in cui sono negoziate le Azioni dei Fondi con l'indicazione dei rispettivi *market makers*.

Classe di azioni	ISIN	Mercato di Negoziazione	Market Maker
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB UCITS ETF - EUR (C)	LU1681042609	Euronext Paris Euronext Amsterdam Deutsche Börse Xetra London Stock Exchange SIX Swiss Exchange	BNP Paribas Arbitrage
AMUNDI MSCI NORDIC UCITS ETF - EUR (C)	LU1681044647	Euronext Paris Deutsche Börse Xetra London Stock Exchange SIX Swiss Exchange	BNP Paribas Arbitrage
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - EUR (C)	LU1681048804	Euronext Paris Deutsche Börse Xetra SIX Swiss Exchange	BNP Paribas Arbitrage
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF - EUR (C)	LU1681045024	Euronext Paris Deutsche Börse Xetra SIX Swiss Exchange	BNP Paribas Arbitrage
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF - EUR (C)	LU1681044480	Euronext Paris. Deutsche Börse Xetra SIX Swiss Exchange	BNP Paribas Arbitrage
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR (C)	LU1681049109	Euronext Paris. Deutsche Börse Xetra SIX Swiss Exchange	BNP Paribas Arbitrage
AMUNDI RUSSELL 2000 UCITS ETF - EUR (C)	LU1681038672	Euronext Paris. Deutsche Börse Xetra SIX Swiss Exchange	BNP Paribas Arbitrage
AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR UCITS ETF - EUR (C)	LU1681041890	Euronext Paris Deutsche Börse Xetra	BNP Paribas Arbitrage

La Società di gestione si riserva la facoltà di presentare istanza di ammissione a quotazione delle Azioni presso altri mercati regolamentati.

5. OPERAZIONI DI ACQUISTO/VENDITA MEDIANTE TECNICHE DI COMUNICAZIONE A DISTANZA

L'acquisto e la vendita delle Azioni può anche avvenire attraverso i siti internet degli Intermediari Abilitati. In tale ultima circostanza, gli Intermediari Abilitati dovranno agire nel rispetto della normativa applicabile, relativa all'offerta tramite mezzi di comunicazione a distanza. La Società di Gestione non sarà responsabile nei confronti degli investitori per quanto concerne la corretta esecuzione degli ordini e delle negoziazioni nei quali la controparte sia un Intermediario Abilitato. La Società di Gestione non sarà inoltre responsabile in caso di inosservanza da parte degli Intermediari Abilitati delle sopramenzionate norme e regolamenti applicabili.

In particolare, gli Intermediari Abilitati possono attivare servizi "on line" che, previa identificazione dell'investitore e rilascio di password o di codice identificativo, consentano allo stesso di impartire richieste di acquisto e di vendita via internet in condizioni di piena consapevolezza. La descrizione delle specifiche procedure da seguire è riportata nei siti operativi.

L'Intermediario Abilitato rilascia all'investitore idonea attestazione dell'avvenuta adesione realizzata mediante internet, con possibilità di acquisire tale attestazione su supporto duraturo.

Si fa presente che, anche in caso di ordini di acquisto/vendita ricevuti e inoltrati tramite internet, restano fermi gli obblighi a carico degli Intermediari Abilitati e previsti dal Regolamento Intermediari.

L'utilizzo del collocamento via internet non comporta variazione degli oneri descritti nel paragrafo 9 del presente Documento per la Quotazione.

6. OPERATORI A SOSTEGNO DELLA LIQUIDITÀ

BNP Paribas Arbitrage, con sede legale in 160-162 boulevard Mac Donald – 75019 Parigi, Francia, è stata incaricata, con apposita convenzione, ad agire in qualità di "Specialista" relativamente alla negoziazione delle Azioni nel Mercato *ETFplus*, segmento "*ETF indicizzati - classe 2*", gestito da Borsa Italiana S.p.A.

Conformemente a quanto stabilito dal Regolamento dei Mercati organizzati e gestiti da Borsa Italiana S.p.A. vigente alla data del presente Documento per la Quotazione, l'operatore Specialista si è impegnato a sostenere la liquidità delle Azioni nel Mercato *ETFplus* assumendo l'obbligo di esporre in via continuativa prezzi di acquisto e di vendita delle Azioni secondo le modalità e i termini stabiliti da Borsa Italiana S.p.A..

7. VALORE INDICATIVO DEL PATRIMONIO NETTO (iNAV)

Durante lo svolgimento delle negoziazioni, SOLACTIVE (con sede legale in Guiollettstrasse 54, 60325 Francoforte, Germania) calcola in via continuativa il valore indicativo del patrimonio netto (iNAV) del Comparto, aggiornandolo ogni quindici secondi.

I codici (ticker) dei Comparti per il reperimento dell'iNAV presso gli info provider Bloomberg e Reuters sono :

Codici iNAV		
Classe di Azione	Reuters	Bloomberg
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF – EUR (C)	AASIEURINAV=S OLA	IAASI
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF – EUR (C)	ALATEURINAV=S OLA	IALAT
AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR UCITS ETF – EUR (C)	QCEUEURINAV=S OLA	IQCEU
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB UCITS ETF DR – EUR (C)	CEUEURINAV=SO LA	INCEU
AMUNDI MSCI NORDIC UCITS ETF – EUR (C)	CN1EURINAV=SO LA	INCN1
AMUNDI RUSSELL 2000 UCITS ETF – EUR (C)	RS2KEURINAV=S OLA	IRS2K
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR (C)	500HEURINAV=SO LA	I500H
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF – EUR (C)	500EURINAV=SOL A	IN500

8. DIVIDENDI

I Fondi hanno la seguente politica di distribuzione dei proventi dell'attività di gestione:

Classe di Azione	Politica di distribuzione dei proventi
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF – EUR (C)	capitalizzazione
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF – EUR (C)	capitalizzazione
AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR UCITS ETF – EUR (C)	capitalizzazione
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB UCITS ETF – EUR (C)	capitalizzazione
AMUNDI MSCI NORDIC UCITS ETF – EUR (C)	capitalizzazione
AMUNDI RUSSELL 2000 UCITS ETF – EUR (C)	capitalizzazione
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR (C)	capitalizzazione
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF – EUR (C)	capitalizzazione

La politica di distribuzione è del tipo a “capitalizzazione” dei proventi; i proventi dalle stesse azioni conseguiti, dunque, non sono distribuiti agli azionisti ma reinvestiti. Rimane facoltà della SICAV deliberare eventuale distribuzione dei proventi. Qualora la SICAV decidesse di distribuire la totalità o una parte dei proventi allora potrà procedere a uno o più pagamenti all'anno.

Nel caso di distribuzione dei proventi, l'entità di tali proventi derivanti dall'attività di gestione, la data di stacco e quella di pagamento dovranno essere comunicati a Borsa Italiana S.p.A. ai fini della diffusione al mercato; tra la data di comunicazione ed il giorno di negoziazione ex diritto deve intercorrere almeno un giorno di mercato aperto.

(B.) INFORMAZIONI ECONOMICHE

9. ONERI DIRETTAMENTE O INDIRETTAMENTE A CARICO DELL'INVESTITORE E REGIME FISCALE

9.1 ONERI PER ACQUISTO/VENDITA SUL MERCATO ETFPLUS

Le richieste di acquisto e vendita delle Azioni effettuate sul Mercato *ETFplus* non sono soggette ad alcuna commissione di sottoscrizione o di rimborso. Agli investitori potranno comunque essere addebitate le commissioni di negoziazione spettanti agli Intermediari Abilitati.

Si fa presente che le commissioni di negoziazione applicate dagli Intermediari Abilitati, sia in relazione alle operazioni di investimento effettuate tramite un sito internet che a quelle effettuate attraverso le modalità tradizionali, possono variare a seconda dell'Intermediario Abilitato prescelto per l'operazione.

Si richiama l'attenzione degli investitori sulla possibilità che l'eventuale margine tra il prezzo di mercato delle Azioni vendute/acquistate nel mercato secondario in una certa data e l'iNAV per Azione calcolato nel medesimo istante potrebbe rappresentare un ulteriore costo, non quantificabile a priori.

9.2 COMMISSIONI DI GESTIONE

Le commissioni di gestione indicate nel "Documento contenente le informazioni chiave per l'investitore" ("**KID**") di ciascun Fondo sono applicate in proporzione al periodo di detenzione delle Azioni.

9.3 REGIME FISCALE

Il regime fiscale che viene di seguito descritto è quello in vigore in Italia al momento della pubblicazione del presente Documento per la Quotazione. Eventuali variazioni che interverranno in futuro saranno comunicate agli investitori nelle forme regolamentari.

- (a) I proventi derivanti dalla partecipazione ad organismi di investimento collettivo in valori mobiliari conformi alle Direttive Comunitarie ("**OICR**") e le cui quote o azioni sono autorizzate al collocamento nel territorio dello Stato sono tassati con una ritenuta ai sensi dell'art. 10-ter della L. 23 marzo 1983, n. 77, così come modificato dall'art. 8, comma V, del D.Lgs. 21 novembre 1997, n. 461 e successive modifiche. Ai sensi del D.L. 24 aprile 2014, n. 66, convertito con L. 23 giugno 2014, n. 89, la ritenuta è applicata con aliquota del 26%. Detta ritenuta è applicata a titolo di acconto delle imposte sui redditi se le azioni o quote ed i proventi vengono rispettivamente acquistate o conseguiti nell'esercizio di un'impresa commerciale. In tutte le altre ipotesi la ritenuta è effettuata a titolo di imposta.
- (b) Normalmente, la ritenuta è operata dagli intermediari residenti incaricati del pagamento dei proventi distribuiti in costanza di partecipazione agli OICR e su quelli compresi nella differenza tra il valore del riscatto, liquidazione o cessione delle azioni o quote e il costo medio ponderato di sottoscrizione o acquisto delle stesse. Il costo di acquisto deve essere documentato dal partecipante e, in mancanza della documentazione, il costo è documentato con una dichiarazione sostitutiva. Detti proventi sono determinati al netto del 48,08% dei proventi riferibili alle obbligazioni e agli altri titoli pubblici italiani (o titoli equiparati), alle obbligazioni emesse da altri Stati esteri che consentono un adeguato scambio di informazioni e alle obbligazioni emesse da enti territoriali dei suddetti Stati. Tra le operazioni rilevanti ai fini della determinazione dei proventi soggetti alla ritenuta sono comprese anche quelle realizzate mediante conversione di quote da uno ad altro comparto del medesimo OICR.
- (c) In caso di OICR esteri a gestione passiva di tipo indicizzato la ritenuta di cui all'art. 10-ter, comma 1, della L. 23 marzo 1983 n. 77 deve essere applicata dall'intermediario incaricato della riscossione ovvero della negoziazione o riacquisto delle azioni o delle quote in quanto:
 - (i) le azioni o le quote di partecipazione a tale tipo di OICR, necessariamente dematerializzate, sono subdepositate presso Monte Titoli S.p.A.; e
 - (ii) i flussi derivanti dai proventi periodici e dalla negoziazione di tali titoli non coinvolgono il soggetto incaricato dei pagamenti, dato che (i) la società di gestione estera (o altro soggetto incaricato) accredita i proventi periodici dell'OICR a Monte Titoli S.p.A., in proporzione al numero di azioni o quote subdepositate presso di essa; (ii) la società Monte Titoli S.p.A. accredita tali proventi agli Intermediari Abilitati in proporzione al numero di azioni o quote dell'OICR detenute dagli stessi per conto dei propri clienti; e
 - (iii) gli Intermediari Abilitati accreditano, infine, i suddetti proventi agli investitori in misura proporzionale al numero delle azioni o delle quote detenute.
- (d) Il regime fiscale applicabile ai trasferimenti per successione o donazione è disciplinato dal D.L. 3 ottobre 2006, n. 262, come da ultimo modificato dall'art. 1, comma 77, della L. 27 dicembre 2006, n. 296 ("Legge Finanziaria 2007"). Ai sensi del citato decreto, non è prevista alcuna imposta

in caso di trasferimento di azioni o quote di OICR a seguito di successione mortis causa o per donazione, a condizione che (i) in caso di trasferimento a favore del coniuge e dei parenti in linea retta, l'ammontare delle azioni o quote di OICR da trasferire, insieme ad eventuali altri beni, per ciascun beneficiario, sia inferiore o uguale a 1.000.000 Euro; (ii) in caso di trasferimento a favore dei fratelli e delle sorelle, l'ammontare delle azioni o quote dell'OICR da trasferire, insieme ad eventuali altri beni, sia inferiore o uguale a 100.000 Euro.

In relazione agli altri casi di trasferimento per successione o donazione, si applicheranno le seguenti aliquote:

Trasferimenti in favore del coniuge e parenti in linea retta (sul valore eccedente 1.000.000 di Euro per ciascun beneficiario): 4%

- Trasferimenti in favore di fratelli e sorelle (sul valore eccedente 100.000 Euro per ciascun beneficiario): 6%
- Trasferimenti in favore di altri parenti fino al 4° e degli affini in linea retta e in linea collaterale fino al 3°: 6%
- Trasferimenti in favore di altri soggetti: 8%

Se il successore o il destinatario della donazione è un portatore di handicap riconosciuto grave ai sensi della L. 5 febbraio 1992, n. 104, la franchigia è pari a 1.500.000 Euro.

Il pagamento delle imposte di successione o donazione sarà effettuato direttamente dal/dai soggetto/i obbligato/i e non tramite ritenuta da parte di un sostituto di imposta.

(C.) INFORMAZIONI AGGIUNTIVE

10. VALORIZZAZIONE DELL'INVESTIMENTO

Il NAV per Azione relativo ai Fondi viene pubblicato quotidianamente sul sito internet www.amundiETF.com e www.borsaitaliana.it.

Relativamente alla periodicità e alle modalità di calcolo del NAV per Azione, si rinvia a quanto stabilito nella sezione "Come viene calcolato il NAV" ("*How we calculate NAV*") del Prospetto della SICAV.

11. INFORMATIVA AGLI INVESTITORI

I seguenti documenti e i successivi aggiornamenti sono disponibili sul sito internet della Società di Gestione (www.amundiETF.com) nonché su quello di Borsa Italiana S.p.A. (www.borsaitaliana.it/ETF):

- il Prospetto e il KID di ciascun Fondo;
- il presente Documento per la Quotazione; e
- l'ultima relazione annuale o semestrale, se successiva (non disponibili sul sito di Borsa Italiana S.p.A.).

Tali documenti sono disponibili anche presso il soggetto che cura l'offerta in Italia. Copia cartacea dei documenti sopra elencati è inviata gratuitamente, entro il termine di una settimana, su semplice richiesta scritta dell'investitore e di tutti gli interessati indirizzata a:

Amundi Index Solutions

5, allée Scheffer,

L-2520 Lussemburgo

E-Mail: info@amundi.tf

Se richiesto, la Società potrà inviare la documentazione di cui sopra anche in formato elettronico mediante tecniche di comunicazione a distanza che consentano al destinatario dei documenti di acquisirne la disponibilità su supporto duraturo.

La SICAV pubblica sul quotidiano *Il Sole 24 Ore*, entro il mese di febbraio di ciascun anno, un avviso contenente l'avvenuto aggiornamento del Prospetto e dei KID pubblicati.

* * * * *