AMUNDI MSCI EUROPE CLIMATE TRANSITION CTB - IE

INFORMES

Comunicación Publicitaria

28/02/2022

RENTA VARIABLE

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : **1 498,50 (EUR)**

Fecha de valor liquidativo y activo gestionado : **28/02/2022**

Activos : **57,33 (millones EUR)**

Código ISIN : **LU1437019992**

Código Bloomberg : **AIEEIEC LX**

Índice de referencia : **100% MSCI EUROPE CLIMATE CHANGE CTB SELECT**

Indice comparativo : **MSCI Europe**

Objetivo de inversión

AMUNDI MSCI EUROPE CLIMATE TRANSITION CTB busca replicar, de la forma más precisa posible, la rentabilidad del MSCI Europe Climate Change CTB Select index, tanto al alza como a la baja.

Perfil de riesgo y rentabilidad (Fuente: Fund Admin)

1	2	3	4	5	**6**	7

A riesgo más bajo, rentabilidad potencialmente más baja

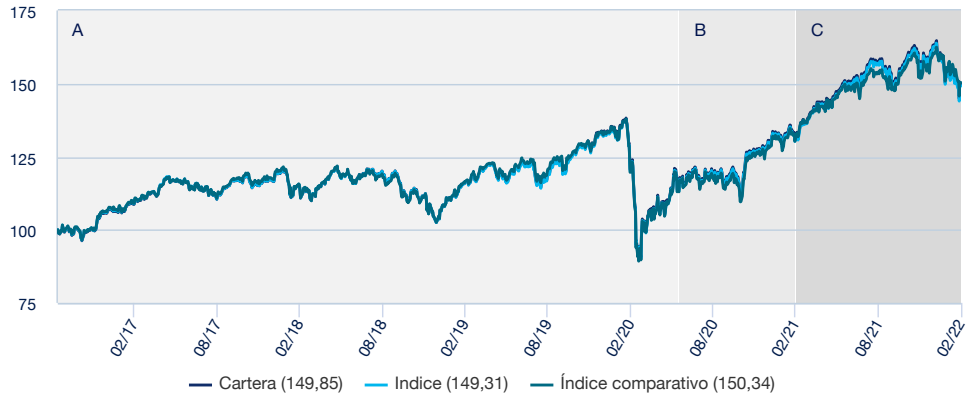
A riesgo más alto, mayor rentabilidad potencial

La categoría más baja no significa "sin riesgo". La categoría de riesgo asociado a este fondo no está garantizada y podrá evolucionar en el tiempo.

« Los valores liquidativos técnicos pueden calcularse y publicarse para cualquier día natural (excluidos los sábados y domingos) que no sea un día hábil ni un día de transacciones. Estos valores liquidativos técnicos son meramente indicativos y no constituirán la base para la compra, el cambio, el reembolso o la transferencia de acciones."

Rentabilidades (Fuente: Fund Admin) - El rendimiento pasado no garantiza los resultados futuros

Evolución de la rentabilidad (base 100) * (Fuente: Fund Admin)



A : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento fue el MSCI Europe Low Carbon Leaders Index.
B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento fue el índice MSCI EUROPE CLIMATE CHANGE.
C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento es el índice MSCI Europe Climate Change CTB Select.

Rentabilidades* (Fuente : Fund Admin)

Desde el	Desde el 31/12/2021	1 mes 31/01/2022	3 meses 30/11/2021	1 año 26/02/2021	3 años 28/02/2019	5 años 28/02/2017	Desde el 12/09/2016
Cartera	-8,04%	-3,13%	-3,41%	14,55%	29,25%	37,61%	49,85%
Índice	-8,01%	-2,93%	-3,17%	14,67%	28,84%	36,82%	49,31%
Diferencia	-0,03%	-0,20%	-0,23%	-0,13%	0,41%	0,79%	0,54%
Índice comparativo	-6,11%	-3,01%	-0,94%	15,43%	29,44%	37,65%	50,34%

Rentabilidades anuales* (Fuente : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017
Cartera	25,82%	-2,15%	29,14%	-12,21%	10,51%
Índice	25,69%	-2,12%	28,78%	-12,33%	10,34%
Diferencia	0,13%	-0,03%	0,36%	0,12%	0,17%

** Las rentabilidades arriba indicadas cubren períodos completos de 12 meses para cada año civil.* ***Las rentabilidades pasadas no presuponen en modo alguno los resultados actuales ni futuros, y no garantizan los rendimientos venideros*** *. Los eventuales beneficios o pérdidas no incluyen los gastos, comisiones o tasas soportados por el inversor en el momento de la emisión y la compra de participaciones (p.ej., impuestos, gastos de intermediación u otras comisiones aplicados por el intermediario financiero). Si las rentabilidades se calculan en una divisa distinta al euro, las fluctuaciones de los tipos de cambio (al alza o a la baja) pueden afectar los eventuales beneficios o pérdidas generados. La diferencia corresponde a la diferencia de rentabilidades de la cartera y del índice.*

Indicadores de riesgo (Fuente: Fund Admin)

	1 año	3 años	5 años
Volatilidad de la cartera	10,34%	19,72%	16,92%
Volatilidad del índice	10,31%	19,67%	16,89%
Tracking Error	0,53%	0,76%	0,61%
Cociente de Sharpe	1,42	0,46	0,41
Ratio de información	-0,20	0,16	0,21

La volatilidad es un indicador estadístico que mide la amplitud de las variaciones de un activo respecto a su media. Ejemplo: unas variaciones diarias de +/- 1,5% en los mercados corresponden a una volatilidad anual del 25%.
sharp_ratio_indicator

AMUNDI MSCI EUROPE CLIMATE TRANSITION CTB - IE

INFORMES
Comunicación Publicitaria
28/02/2022

RENTA VARIABLE

Conozca al Equipo

Lionel Brafman
Responsable Gestión Índice & Multistrategy

Isabelle Lafargue
Responsable adjunta del equipo Índice y Multistratégias

Pierre NAVARRE
Gerente de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice MSCI Europe Climate Change CTB Select es un índice de renta variable basado en el índice MSCI Europe («Índice padre»), representativo de los valores de gran y mediana capitalización de 15 países desarrollados de Europa (a diciembre de 2020). El Índice tiene por objetivo reproducir la rentabilidad de una estrategia que repondera los valores según las oportunidades y los riesgos asociados al clima de transición relacionado con el cumplimiento de los requisitos mínimos del EU Climate Transition Benchmark (EU CTB).

Características (Fuente : Amundi)

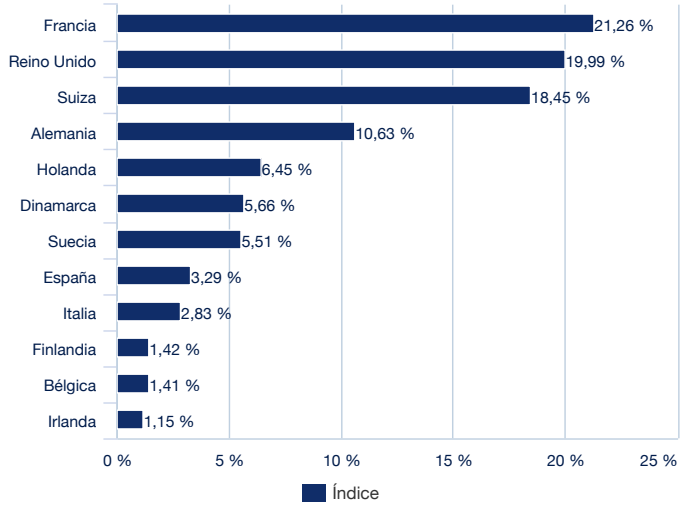
Clase de activo : **Renta variable**
Exposición : **Europa**
Ticker Bloomberg del índice : **MXEUTBNE**

total de valores : **401**

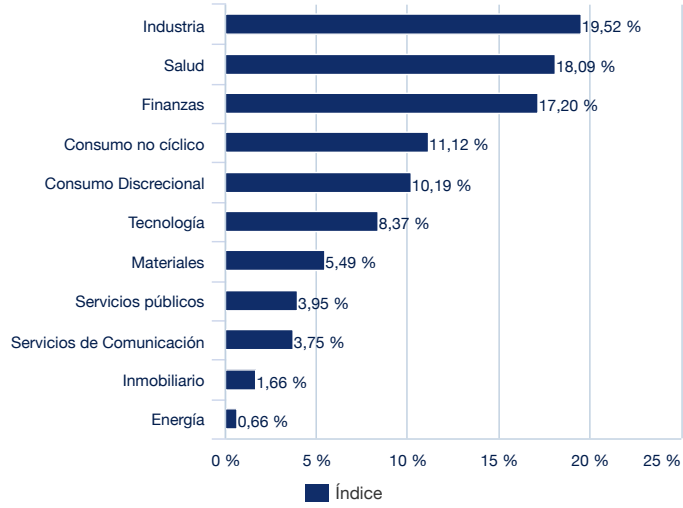
Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)
LVMH MOET HENNESSY	3,44%
NOVARTIS	3,26%
ROCHE HLDG AG-GENUSS	2,93%
ASML HOLDING NV	2,91%
NESTLE SA-REG	2,75%
SCHNEIDER ELECT SE	2,37%
ASTRAZENECA GBP	2,07%
NOVO NORDISK A/S-B NEW	1,90%
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,80%
ABB LTD	1,40%
Total	**24,83%**

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Comentario de gestión

Los indicadores económicos publicados en febrero revelan una mejoría de la actividad, tanto en EE.UU. como en Europa, fruto del retroceso de la pandemia de covid-19. No obstante, la inflación se ha situado en nuevos máximos. Pero, sobre todo, la invasión de Ucrania por Rusia ha añadido un enorme factor de incertidumbre durante los últimos días del mes. En los mercados, el inicio de este conflicto ha provocado un descenso de la renta variable y los bonos, contrariamente a las tendencias observadas a principios de mes.
En Europa, los valores cíclicos han retrocedido más que los defensivos, mientras que los títulos *value* han evolucionado en línea con los valores de crecimiento. Por sectores, las finanzas han acusado el mayor golpe, seguidas del consumo discrecional, y a continuación de la tecnología y la industria. La energía ha amortiguado el impacto y tres sectores han logrado beneficios: la salud, los materiales básicos y los servicios públicos.

En este contexto, el MSCI Europe Climate Transition ha registrado una rentabilidad del -2,93%, un 0,08% por encima del MSCI Europe.
La redistribución trimestral del índice ha tenido lugar el 28 de febrero: en esta ocasión, Fortum, Veolia y Uniper han salido del índice de referencia, con una ponderación del 0,18%.

Amundi
ASSET MANAGEMENT

Amundi Asset Management, SAS (French : Société par Actions Simplifiée) con un capital de 1 086 262 605 €
Sociedad gestora de carteras autorizada por la AMF N° GP 04000036
Sede social: 91-93, boulevard Pasteur – 75015 París – Francia 437 574 452 RCS París
Material dirigido únicamente a inversores «profesionales».

Características principales (Fuente : Amundi)

Naturaleza jurídica	IICVM de Derecho luxemburgués
Normativa UCITS	OICVM
Sociedad gestora	Amundi Luxembourg SA
Sub Delegación Financiera	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Custodio	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Auditor Externo	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Fecha de creación	29/06/2016
Divisa de referencia de la clase	EUR
Clasificación	-
Asignación de los resultados	Participaciones de Capitalización
Código ISIN	LU1437019992
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,18% (realizado) - 19/01/2022
Periodo mínimo de inversión recomendado	5 años
Cierre fiscal	Septiembre
Código CNMV	-

Menciones legales

El presente documento se facilita a título informativo y en ningún caso constituye una recomendación, solicitación, oferta, consejo ni invitación de compra o venta de participaciones o acciones de los fondos de inversión colectiva, fondos de inversión de riesgo, SICAV ni compartimentos de SICAV o SPPICAV presentados en este documento («las IIC»), y en ningún caso debe interpretarse como tal. El presente documento no constituye la base de un contrato o compromiso de ninguna naturaleza. Toda la información contenida en este documento podrá ser modificada sin previo aviso. La sociedad gestora no asumirá ninguna responsabilidad, directa o indirecta, que pueda resultar del uso de la información contenida en este documento. La sociedad gestora no se hace responsable de las decisiones que se tomen sobre la base de esta información. La información contenida en el presente documento tiene un carácter confidencial y no podrá ser copiada, reproducida, modificada, traducida ni difundida sin el acuerdo previo por escrito de la sociedad gestora a ningún tercero ni en ningún país donde dicha difusión o uso sea contraria a las disposiciones legales y reglamentarias, o que imponga a la sociedad gestora o a sus fondos obligaciones de registro ante las autoridades de tutela de dichos países. No todas las IIC están sistemáticamente registradas en el país de jurisdicción de todos los inversores. Invertir implica riesgos: las rentabilidades pasadas de las IIC presentadas en este documento, así como las simulaciones realizadas sobre la base de estas últimas, no presuponen ni constituyen un indicador fiable de las rentabilidades futuras. Los valores de las participaciones o acciones de las IIC están sujetos a las fluctuaciones del mercado, de modo que las inversiones realizadas pueden variar al alza o a la baja. Por tanto, los suscriptores de IIC pueden perder todo o parte del capital inicialmente invertido. Previamente a cualquier suscripción, es responsabilidad de las personas interesadas por las IIC asegurarse de la compatibilidad de dicha suscripción con las leyes que la rigen, de las consecuencias fiscales de su inversión y de familiarizarse con los documentos reglamentarios en vigor de cada IIC. Salvo indicación contraria, la fuente de los datos del presente documento es la sociedad gestora. Salvo indicación contraria, la fecha de los datos del presente documento es la indicada bajo la mención RESUMEN MENSUAL DE GESTIÓN, en el encabezamiento del documento.

Documento dirigido exclusivamente a inversores institucionales, profesionales, cualificados o sofisticados y distribuidores. No debe destinarse al público en general, a clientela privada ni a los particulares en el sentido de cualquier jurisdicción, ni tampoco a los ciudadanos de Estados Unidos. En la Unión Europea se dirige a inversores «Profesionales» en el sentido de la Directiva 2004/39/CE de 21 de abril de 2004 «MiFID» o, en su caso, en el sentido de cada reglamentación local y, en la medida que se incluya la oferta en Suiza, a «inversores cualificados» en el sentido de las disposiciones de la Ley sobre inversiones colectivas (CISA), la Ordenanza sobre inversiones colectivas de 22 de noviembre de 2006 (CISO) y la Circular FINMA 08/8 en el sentido de la legislación sobre inversiones colectivas de 20 de noviembre de 2008. Este documento no deberá facilitarse en ningún caso en la Unión Europea a inversores no «Profesionales» en el sentido de MiFID o en el sentido de cada reglamentación local, o en Suiza a inversores que no respondan a la definición de «inversores cualificados» en el sentido de la legislación y de la reglamentación aplicable.