

# AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT - IE

INFORMES

Comunicación  
Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE ■

## Datos clave (Fuente : Amundi)

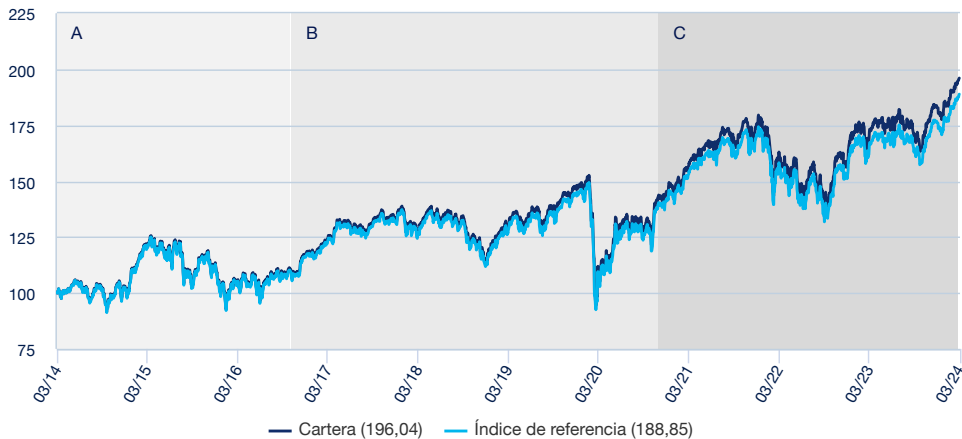
Valor liquidativo : (C) 2 516,65 ( EUR )  
(D) 1 732,17 ( EUR )  
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :  
28/03/2024  
Activos : 1 944,06 ( millones EUR )  
Código ISIN : (C) LU0389810994  
(D) LU0389811026  
Código Bloomberg : (C) CAIDXIC LX  
(D) CAIDXID LX  
Índice de referencia :  
100% MSCI EMU ESG LEADERS SEL 5% CAPPED

## Objetivo de inversión

AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT busca replicar, de la forma más precisa posible, la rentabilidad del MSCI EMU ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index (rentabilidad total). Este compartimiento ofrece exposición a empresas de mediana y gran capitalización de 10 países de la Unión Monetaria Europea, utilizando un enfoque de 'Best In Class', seleccionando sólo las empresas que tienen las más altas calificaciones del MSCI ESG. Además, las empresas que muestran participación en alcohol, juegos de azar, tabaco, carbón térmico, energía nuclear, armas convencionales, armas nucleares, armas controvertidas y armas de fuego civiles, están excluidas del Índice y cada peso constitutivo tiene un tope del 5%.

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

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



A : Simulación basada en la rentabilidad desde el 23 de septiembre de 2008 hasta el 30 de octubre de 2016 del Compartimiento luxemburgués "INDEX EQUITY EURO" de la SICAV "AMUNDI FUNDS" gestionada por Amundi Asset Management y absorbida por AMUNDI INDEX MSCI EMU el 31 de octubre de 2016.

B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimiento fue el MSCI EMU

C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimiento es el MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped

### Rentabilidades \* (Fuente: Fund Admin)

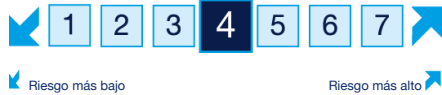
|            | Desde el   | Desde el   | 1 mes      | 3 meses    | 1 año      | 3 años     | 5 años     | 10 años    | Desde el |
|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|----------|
|            | 29/12/2023 | 29/02/2024 | 29/12/2023 | 31/03/2023 | 31/03/2021 | 29/03/2019 | 31/03/2014 | 23/09/2008 |          |
| Cartera    | 7,17%      | 3,34%      | 7,17%      | 13,22%     | 24,32%     | 51,01%     | 96,12%     | 152,23%    |          |
| Índice     | 7,13%      | 3,53%      | 7,13%      | 12,97%     | 22,67%     | 47,76%     | 88,95%     | 139,26%    |          |
| Diferencia | 0,05%      | -0,19%     | 0,05%      | 0,25%      | 1,65%      | 3,24%      | 7,17%      | 12,96%     |          |

### Rentabilidades anuales \* (Fuente: Fund Admin)

|            | 2023   | 2022    | 2021   | 2020   | 2019   | 2018    | 2017   | 2016  | 2015   | 2014  |
|------------|--------|---------|--------|--------|--------|---------|--------|-------|--------|-------|
| Cartera    | 17,18% | -10,89% | 21,43% | -1,28% | 28,75% | -14,65% | 13,61% | 3,79% | 10,88% | 4,80% |
| Índice     | 16,69% | -11,35% | 20,74% | -1,48% | 28,17% | -14,98% | 13,39% | 3,49% | 10,75% | 4,24% |
| Diferencia | 0,49%  | 0,46%   | 0,70%  | 0,20%  | 0,59%  | 0,32%   | 0,22%  | 0,30% | 0,13%  | 0,55% |

\* Las rentabilidades arriba indicadas cubren periodos 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.

### Indicador de Riesgo (Fuente: Fund Admin)



El indicador de riesgo presupone que usted mantendrá el producto durante 5 años.

El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

### Indicadores de riesgo (Fuente: Fund Admin)

|                           | 1 año  | 3 años | 5 años |
|---------------------------|--------|--------|--------|
| Volatilidad de la cartera | 12,65% | 15,77% | 20,36% |
| Volatilidad del índice    | 12,27% | 15,50% | 20,19% |
| Tracking Error            | 1,06%  | 0,94%  | 0,84%  |
| Ratio de Sharpe           | 0,76   | 0,39   | 0,39   |
| Ratio de información      | 0,24   | 0,51   | 0,56   |

\* 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

RENTA VARIABLE ■

Conozca al Equipo



**Lionel Brafman**  
Responsable Gestión Índice & Multistrategy



**Vincent Masson**  
Gestor de cartera senior



**Jerome Gueguen**  
Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice MSCI EMU ESG Leaders Select 5% Issuer Capped es un índice de renta variable basado en el índice MSCI EMU («Índice padre»), representativo de las acciones de gran y mediana capitalización de 10 países desarrollados (a septiembre de 2020) de la Unión Económica y Monetaria de la Unión Europea (EMU, por sus siglas en inglés) y emitidos por sociedades con las calificaciones ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) más altas en cada sector del Índice padre.

Características (Fuente : Amundi)

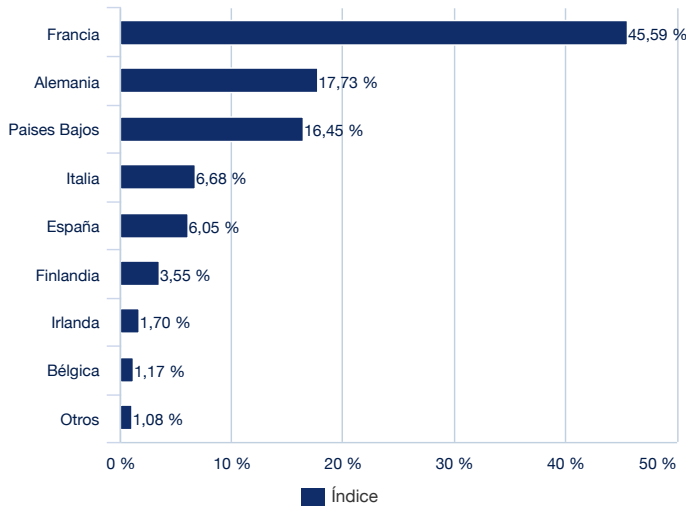
Clase de activo : **Renta variable**  
Exposición : **Zona euro**

total de valores : **94**

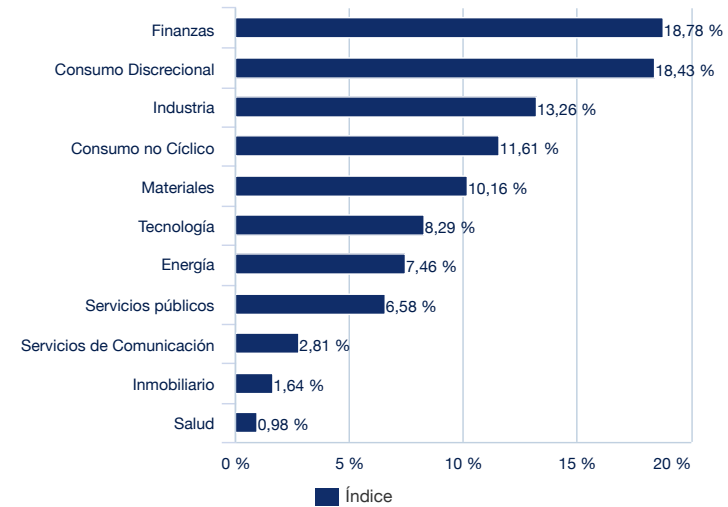
Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

|                              | % de activos (índice) |
|------------------------------|-----------------------|
| TOTALENERGIES SE PARIS       | 5,07%                 |
| ASML HOLDING NV              | 4,95%                 |
| SCHNEIDER ELECT SE           | 4,92%                 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 4,83%                 |
| L OREAL                      | 4,74%                 |
| AIR LIQUIDE SA               | 4,68%                 |
| HERMES INTERNATIONAL         | 3,47%                 |
| IBERDROLA SA                 | 3,27%                 |
| BNP PARIBAS                  | 3,15%                 |
| AXA SA                       | 2,93%                 |
| <b>Total</b>                 | <b>42,00%</b>         |

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Comentario de gestión

Los mercados de renta variable han proseguido su ascenso, respaldados por el tono *dovish* de los bancos centrales y por unos datos económicos mejores de lo esperado. De rebote, las bolsas mundiales lo han aprovechado, con un avance del índice MSCI ACWI del 3,1%. Estados Unidos ha crecido un 3,1%, por debajo de Europa (+4%). Los mercados de la zona euro (+4,3%) han evolucionado mejor, con las mayores contribuciones procedentes de Italia (+7,3%) y España (+11,1%). Fuera de la zona euro, el mercado sueco (+3,0%) ha sabido aprovechar la tendencia alcista en marzo. Todavía en los mercados desarrollados, la tendencia alcista del mercado japonés (+3,4%) se ha prolongado este mes. El MSCI Emerging Markets ha progresado (+2,7%), favorecido por la buena evolución de los mercados taiwanés (+9%) y surcoreano (+6%). Por sectores, en Europa los títulos cíclicos (+4,3%) han superado a los defensivos (+3,5%), encabezados por los sectores bancario (+9,1%), inmobiliario (+8,2%) y de la energía (+6,8%). A pesar de sus resultados positivos, el sector de los bienes de consumo básico (+1,5%) y el de los bienes de consumo cíclico (+2,2%) han sido los grandes perdedores este mes. En Europa, los valores de crecimiento (+3,4%) se han visto superados por títulos *value* (+4,7%).

RENTA VARIABLE ■

Características principales (Fuente : Amundi)

|                                         |                                                           |
|-----------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| Forma 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                           | Non applicable                                            |
| Asignación de los resultados            | (C) Participaciones de Capitalización<br>(D) Distribución |
| Código ISIN                             | (C) LU0389810994<br>(D) LU0389811026                      |
| Valoración                              | Diaria                                                    |
| Gastos corrientes                       | 0,15% ( realizado ) - 08/02/2023                          |
| Periodo mínimo de inversión recomendado | 5 años                                                    |
| Sobre fiscal                            | Eligible para el PEA                                      |
| Cierre fiscal                           | Diciembre                                                 |
| Código CNMV                             | -                                                         |

Menciones legales

El presente documento se facilita a título informativo y en ningún caso constituye una recomendación, solicitud, 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 SPICAV 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. La fecha de los datos en este documento es la indicada en la parte superior del documento, a menos que se indique lo contrario.

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.