

# AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT - IE

INFORMES

Comunicación  
Publicitaria

28/02/2022

RENTA VARIABLE ■

## Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : (C) 2 050,64 ( EUR )  
(D) 1 504,61 ( EUR )

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

Activos : 2 306,61 ( 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 (Fuente : Amundi)

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 compartimento 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%.

## Perfil de riesgo y rentabilidad (Fuente: Fund Admin)



◀ A riesgo más bajo, rentabilidad potencialmente más baja

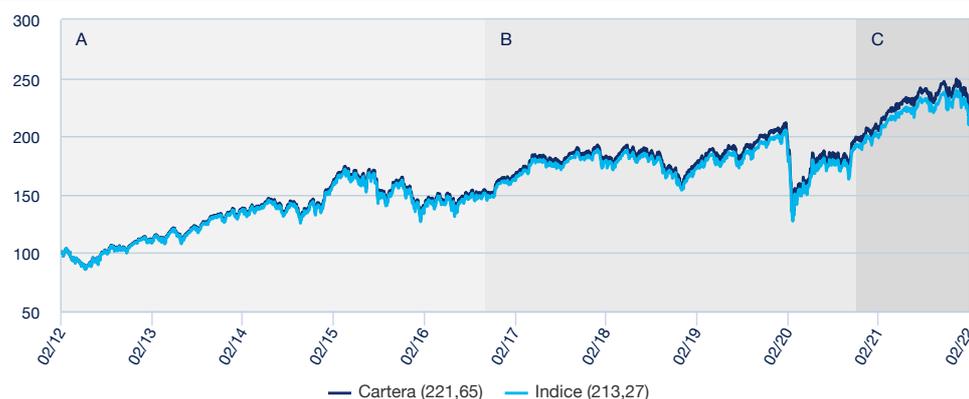
▶ A riesgo más alto, mayor rentabilidad potencial

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 : Simulación basada en la rentabilidad desde el 23 de septiembre de 2008 hasta el 30 de octubre de 2016 del Compartimento 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 Compartimento fue el MSCI EMU

C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento 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	Desde el
	31/12/2021	31/01/2022	30/11/2021	26/02/2021	28/02/2019	28/02/2017	23/09/2008	
<b>Cartera</b>	-8,81%	-7,06%	-4,09%	8,26%	24,70%	33,94%	105,52%	
<b>Índice</b>	-8,99%	-7,06%	-4,12%	7,42%	22,95%	31,25%	96,49%	
<b>Diferencia</b>	0,18%	0,00%	0,03%	0,84%	1,76%	2,69%	9,04%	

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

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
<b>Cartera</b>	21,43%	-1,28%	28,75%	-14,65%	13,61%	3,79%	10,88%	4,80%	23,82%	19,69%
<b>Índice</b>	20,74%	-1,48%	28,17%	-14,98%	13,39%	3,49%	10,75%	4,24%	23,45%	18,95%
<b>Diferencia</b>	0,70%	0,20%	0,59%	0,32%	0,22%	0,30%	0,13%	0,55%	0,37%	0,75%

\* 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.

### Indicadores de riesgo (Fuente : Amundi)

	1 año	3 años	5 años
<b>Volatilidad de la cartera</b>	11,49%	22,13%	18,91%
<b>Volatilidad del índice</b>	11,34%	22,05%	18,85%
<b>Tracking Error</b>	0,83%	0,72%	0,56%
<b>Cociente de Sharpe</b>	0,87	0,37	0,36
<b>Ratio de información</b>	0,77	0,61	0,69

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 &amp; Multistrategy

**Vincent Masson**

Gerente de cartera senior

**Jerome Gueguen**

Gerente 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.

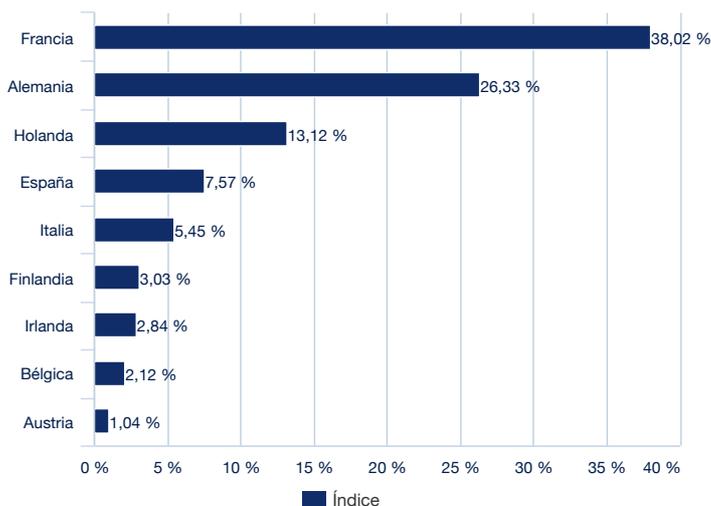
## Características (Fuente : Amundi)

Clase de activo : **Renta variable**Exposición : **Zona euro**Bloomberg Index Ticker : **MXEMUEL5**total de valores : **104**

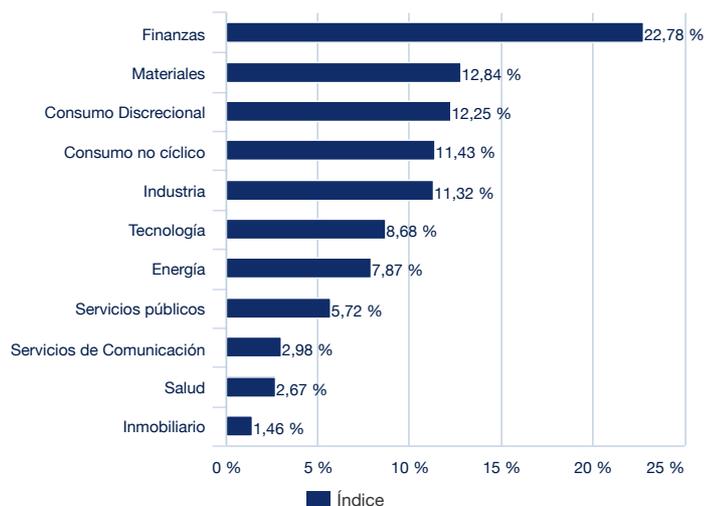
## Principales líneas del índice

	% de activos (índice)
TOTALENERGIES SE	5,63%
SAP SE	4,47%
ASML HOLDING NV	4,21%
L OREAL	4,13%
ALLIANZ SE-REG	3,98%
SCHNEIDER ELECT SE	3,52%
AIR LIQUIDE SA	3,26%
BNP PARIBAS	2,97%
IBERDROLA SA	2,69%
BASF SE XETRA	2,58%
<b>Total</b>	<b>37,43%</b>

## Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



## Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



## Comentario de gestión

Retrceso de los mercados bursátiles europeos en febrero (MSCI EMU -5,23%). Los principales índices de renta variable han caído (DAX -6,5%, CAC -4,9%), penalizados por la transformación en guerra del conflicto geopolítico entre Rusia y Ucrania. Pese a las negociaciones iniciadas con Estados Unidos y la UE, Rusia ha decidido concretar sus amenazas invadiendo Ucrania. Como represalia, Estados Unidos y la UE han anunciado una serie de sanciones contra Rusia, como la congelación de sus activos financieros y la exclusión de algunos bancos del país del sistema de transacciones internacionales Swift. Destaca la evolución prácticamente estable del FTSE 100 (-0,1%), beneficiado por su exposición a los sectores de los metales y las minas y de la defensa.

Buena evolución de los sectores indexados con las materias primas, que han progresado con fuerza a lo largo de todo el mes ante los temores relativos a su aprovisionamiento. El barril de Brent ha superado los 100 USD y el precio del acero ha aumentado cerca de un 14,9%.

Por sectores, los recursos básicos (+8,5%) han logrado los mejores resultados, a pesar del fuerte desplome de Polymetal International (-66,9%) a causa de su muy amplia exposición a Rusia. De forma general, todos los valores expuestos a Rusia han registrado pérdidas.

Los sectores de los servicios públicos (+1,9%) y la energía (+0,8%) han aprovechado el fuerte incremento de los precios energéticos y el rali de los valores renovables, sobre todo tras las declaraciones de la Comisión Europea (Ursula von der Leyen), según las cuales la UE debería diversificar sus fuentes de energía invirtiendo masivamente en energías verdes.

Todo lo contrario ha sucedido con los sectores financieros: los seguros (-7,8%) y la banca (-9,3%) han retrocedido, afectados por las inquietudes macroeconómicas y el descenso de los tipos estadounidenses/alemanes, que han contrarrestado unos resultados de buena factura, al igual que el sector de las ventas minoristas (-10,3%), a pesar de unos resultados con frecuencia mejores de lo previsto.

En febrero ha llevado a cabo la revisión trimestral del índice, a precio de cierre del 28 de agosto. No ha habido entradas ni salidas.

## RENTA VARIABLE ■

## 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	Non aplicable
Asignación de los resultados	(C) Participaciones de Capitalización (D) Distribución
Código ISIN	(C) LU0389810994 (D) LU0389811026
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,15% ( realizado ) - 19/01/2022
Periodo mínimo de inversión recomendado	5 años
Sobre fiscal	Eligible para el PEA
Cierre fiscal	Septiembre
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. 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.