

# AMUNDI INDEX MSCI EUROPE - IE

INFORMES

Comunicación  
Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE

## Datos clave (Fuente : Amundi)

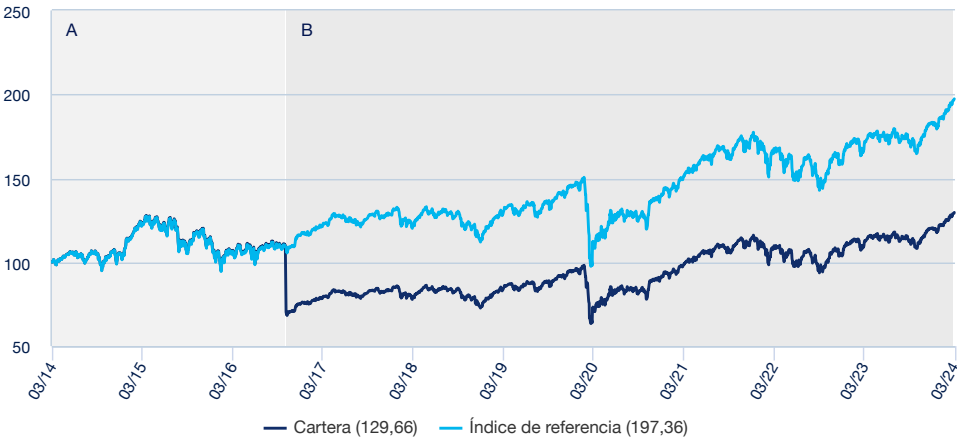
Valor liquidativo : (C) 286,44 ( EUR )  
(D) 1 912,03 ( EUR )  
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :  
28/03/2024  
Activos : 4 028,15 ( millones EUR )  
Código ISIN : (C) LU0389811539  
(D) LU0389811612  
Código Bloomberg : (C) CAIXEIA LX  
(D) CAIXEID LX  
Índice de referencia : MSCI EUROPE

## Objetivo de inversión

Este ETF busca replicar de la forma más precisa posible la rentabilidad del índice MSCI Europe tanto al alza como a la baja.

## 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 25 de septiembre de 2008 hasta el 30 de octubre de 2016 del Compartimento luxemburgués "INDEX EQUITY EUROPE" de la SICAV "AMUNDI FUNDS" gestionada por Amundi Asset Management y absorbida por AMUNDI INDEX MSCI EUROPE el 31 de octubre de 2016.  
B : Rendimiento del Subfondo desde la fecha de su lanzamiento

### 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 | -      | -       | 31/10/2016 |
| Cartera    | 7,76%      | 3,91%      | 7,76%      | 14,92%     | 31,38%     | 54,33%     | -      | -       | 84,39%     |
| Índice     | 7,63%      | 3,94%      | 7,63%      | 14,79%     | 30,31%     | 52,47%     | -      | -       | 81,50%     |
| Diferencia | 0,13%      | -0,03%     | 0,13%      | 0,13%      | 1,07%      | 1,86%      | -      | -       | 2,89%      |

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

|            | 2023   | 2022   | 2021   | 2020   | 2019   | 2018    | 2017   | 2016  | 2015  | 2014  |
|------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|-------|-------|-------|
| Cartera    | 16,05% | -9,25% | 25,41% | -3,16% | 29,48% | -12,52% | 10,71% | 1,80% | 9,49% | 7,02% |
| Índice     | 15,83% | -9,49% | 25,13% | -3,32% | 29,12% | -12,70% | 10,61% | 1,69% | 9,27% | 6,76% |
| Diferencia | 0,22%  | 0,25%  | 0,28%  | 0,16%  | 0,36%  | 0,17%   | 0,10%  | 0,11% | 0,22% | 0,26% |

\* 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)



Riesgo más bajo Riesgo más alto

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 | 11,08% | 13,73% | 18,16% |
| Volatilidad del índice    | 10,86% | 13,48% | 17,88% |
| Tracking Error            | 0,91%  | 0,98%  | 0,97%  |
| Ratio de Sharpe           | 1,02   | 0,59   | 0,47   |
| Ratio de información      | 0,14   | 0,30   | 0,27   |

\* 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 & Multistategy



**Isabelle Lafargue**  
Responsable Gestión Índice & Multiestrategias –  
Fondos Regionales



**Quentin Berrou**  
Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice MSCI Europe está compuesto por cerca de 440 valores de entre los más importantes de 15 países europeos.

Las asignaciones presentadas son las del Índice.

Características (Fuente : Amundi)

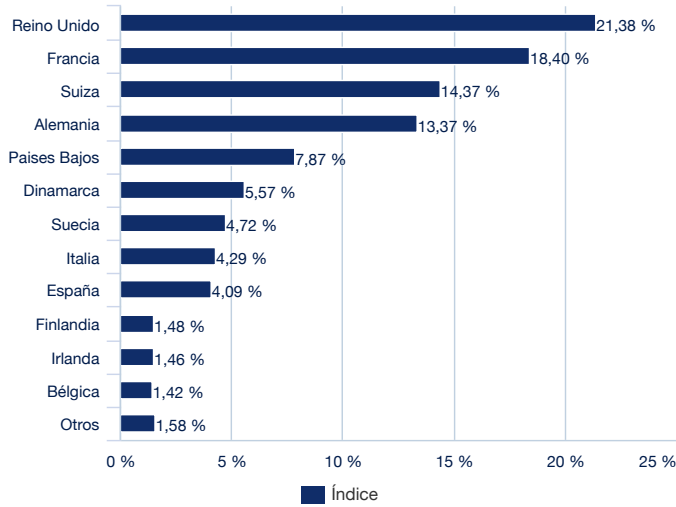
Clase de activo : **Renta variable**  
Exposición : **Europa**

total de valores : **421**

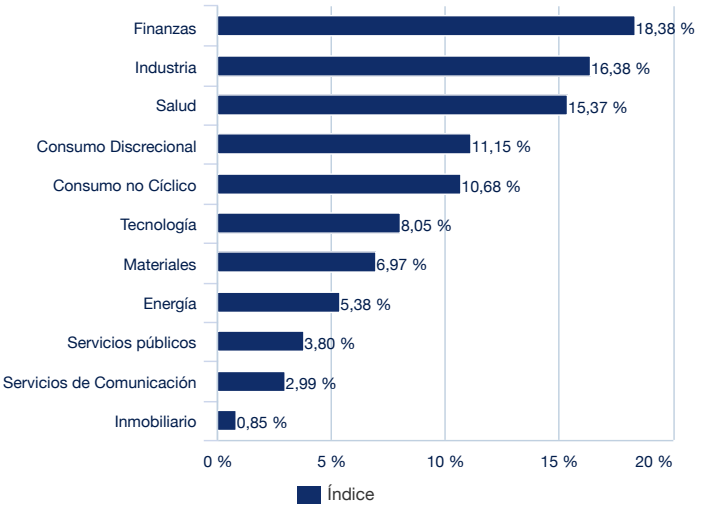
Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

|                              | % de activos (índice) |
|------------------------------|-----------------------|
| HSBC HOLDING PLC GBP         | 1,36%                 |
| ROCHE HLDG AG-GENUSS         | 1,62%                 |
| NOVARTIS AG-REG              | 1,80%                 |
| SAP SE / XETRA               | 1,85%                 |
| ASTRAZENECA GBP              | 1,90%                 |
| SHELL PLC                    | 1,96%                 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 2,25%                 |
| NESTLE SA-REG                | 2,57%                 |
| ASML HOLDING NV              | 3,52%                 |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 3,78%                 |
| <b>Total</b>                 | <b>22,61%</b>         |

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Comentario de gestión

Los datos de Estados Unidos publicados en marzo han confirmado el buen comportamiento de la economía del país. En Europa, señalan una muy ligera mejoría desde una situación de casi estancamiento. En los países emergentes, los indicadores han mostrado algunas divergencias entre regiones. La inflación continúa reduciéndose a ambos lados del Atlántico, aunque de forma más gradual que a finales de 2023. Estados Unidos ha evolucionado por debajo de Europa. Los mercados de la zona euro han evolucionado mejor, con las mayores contribuciones procedentes de Italia y España. Fuera de la zona euro, el mercado sueco ha sabido aprovechar la tendencia alcista en marzo. Por sectores, en Europa los títulos cíclicos han superado a los defensivos, encabezados por los sectores bancario, inmobiliario y de la energía. A pesar de sus resultados positivos, el sector de los bienes de consumo básico y el de los bienes de consumo cíclico han sido los grandes perdedores este mes. En Europa, los valores de crecimiento han evolucionado por debajo de los títulos *value*.

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                           | -                                                         |
| Asignación de los resultados            | (C) Participaciones de Capitalización<br>(D) Distribución |
| Código ISIN                             | (C) LU0389811539<br>(D) LU0389811612                      |
| Valoración                              | Diaria                                                    |
| Gastos corrientes                       | 0,15% ( realizado ) - 08/02/2023                          |
| Periodo mínimo de inversión recomendado | 5 años                                                    |
| 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.