

# AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB - AU

INFORMES

Comunicación  
Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE ■

## Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : (C) 511,44 ( USD )  
(D) 252,03 ( USD )  
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :  
28/03/2024  
Activos : 1 964,12 ( millones USD )  
Código ISIN : LU0442407853  
Código Bloomberg : (C) CAINAC5 LX  
(D) AMIAAUD LX  
Índice de referencia :  
100% MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB  
SELECT

## Objetivo de inversión

El objetivo de este Compartimento es reproducir la rentabilidad del índice MSCI North America ESG Broad CTB Select, y minimizar el error de seguimiento entre el valor liquidativo del Compartimento y la rentabilidad del Índice. El Compartimento trata de lograr un nivel de error de seguimiento entre el Compartimento y su índice que normalmente no supere el 1 %.

## 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.

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

### Evolución del resultado (VL) \* (Fuente : Fund Admin)



A : Simulación basada en la rentabilidad desde el 24 de septiembre de 2008 hasta el 30 de octubre de 2016 del Compartimento luxemburgués "INDEX EQUITY NORTH AMERICA" de la SICAV "AMUNDI FUNDS" gestionada por Amundi Asset Management y absorbida por AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA el 31 de octubre de 2016.

B : Rendimiento del Subfondo desde la fecha de su lanzamiento

C : Since this date, the sub fund will move his benchmark from MSCI North America to MSCI North America ESG Broad CTB Select Index

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

Desde el	Desde el	1 mes	3 meses	1 año	3 años	5 años	Desde el
	29/12/2023	29/02/2024	29/12/2023	31/03/2023	31/03/2021	29/03/2019	21/12/2009
<b>Cartera</b>	9,33%	2,98%	9,33%	27,38%	31,15%	89,94%	412,27%
<b>Índice</b>	9,43%	3,01%	9,43%	27,80%	32,58%	92,75%	432,06%
<b>Diferencia</b>	-0,10%	-0,03%	-0,10%	-0,43%	-1,43%	-2,80%	-19,79%

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

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
<b>Cartera</b>	24,99%	-19,72%	26,15%	19,76%	31,46%	-6,75%	20,64%	11,23%	-1,25%	11,73%
<b>Índice</b>	25,40%	-19,34%	26,44%	19,94%	31,81%	-6,53%	20,89%	11,57%	-0,90%	11,90%
<b>Diferencia</b>	-0,41%	-0,38%	-0,28%	-0,19%	-0,35%	-0,22%	-0,25%	-0,34%	-0,35%	-0,16%

## Características principales (Fuente : Amundi)

Forma jurídica : IICVM  
Fecha de creación : 29/06/2016  
Elegibilidad : -  
Eligible PEA : No  
Asignación de los resultados :  
(C) Participaciones de Capitalización  
(D) Distribución  
Mínimo de la primera suscripción :  
1 milésima parte de participación  
Hora límite de recepción de órdenes :  
Órdenes recibidas cada día D antes 14:00  
Gastos de entrada (máximo) : 4,50%  
Gastos corrientes : 0,30% ( realizado )  
Gastos de salida (máximo) : 0,00%  
Periodo mínimo de inversión recomendado : 5 años  
Comisión de rentabilidad : No

## Indicadores de Riesgo (Fuente : Fund Admin)

	1 año	3 años	5 años	10 Años
<b>Volatilidad de la cartera</b>	12,15%	17,01%	20,12%	16,87%
<b>Volatilidad del índice</b>	12,08%	16,94%	20,07%	16,84%

\* 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%.

## RENTA VARIABLE ■

\* 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.

## Conozca al Equipo



Isabelle Lafargue

Responsable Gestión Índice &amp; Multiestrategias – Fondos Regionales



Jerome Gueguen

Lead Portfolio Manager



Vincent Masson

Gestor de cartera suplente

## Comentario de gestión

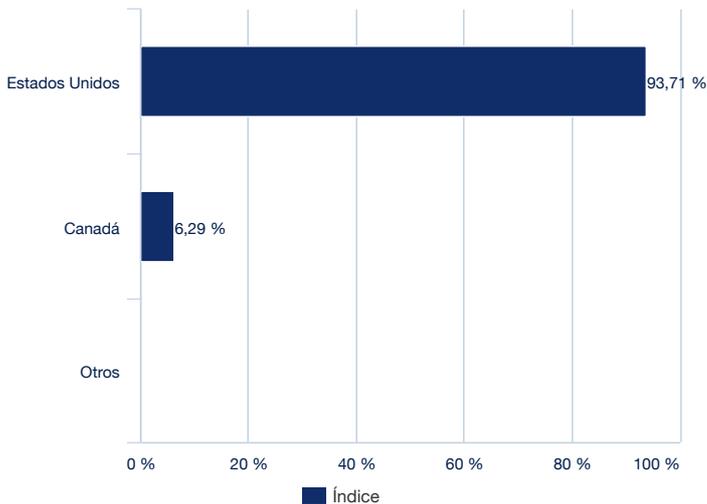
La economía estadounidense ha seguido contradiciendo los pronósticos de una neta desaceleración. El mercado laboral se ha mantenido boyante en febrero, con la creación de 275 000 empleos netos, aunque los datos de los dos meses anteriores, también muy elevados, se han revisado a la baja. Con todo, la tasa de desempleo se ha incrementado hasta el 3,9%, frente a un 3,7% en enero. Por su parte, los índices ISM continúan señalando una ampliación de la actividad en los servicios, pese a que persiste la contracción en la industria. Aunque ha superado ligeramente las previsiones, la inflación subyacente ha seguido desacelerándose en febrero. Así, la progresión del índice general de precios se ha situado en el 3,2% interanual (3,1% en enero), y el índice subyacente se ha frenado hasta el 3,8% (3,9% el mes anterior). El alza del índice Core PCE (referencia para la Reserva Federal) ha marcado un 2,8% en febrero, tras registrar un 2,9% en enero. Durante el FOMC (Comité de Política Monetaria) de marzo, el gobernador de la Reserva Federal, Jerome Powell, ha tratado de minimizar la decepción que ha supuesto el retroceso más lento de lo previsto de los precios. Los gobernadores de la Fed han seguido indicando que prevén un descenso de los tipos de los Fed Funds de 75 pb al término de 2024 (previsión media).

## Datos del índice (Fuente : Amundi)

## Descripción

El índice MSCI North America ESG Broad CTB Select es un índice de renta variable basado en el índice MSCI North America, representativo de los valores de gran y mediana capitalización de los mercados estadounidense y canadiense (el «Índice padre»). El índice excluye aquellas sociedades cuyos productos tienen impactos ambientales o sociales negativos, mientras que sobrepondera a las sociedades con una sólida puntuación ESG. Además, el índice tiene por objetivo replicar la rentabilidad de una estrategia que repondera los valores según las oportunidades y los riesgos asociados a la transición climática para cumplir con los requisitos mínimos del reglamento relativo a los índices de referencia de transición climática de la UE (EU CTB).

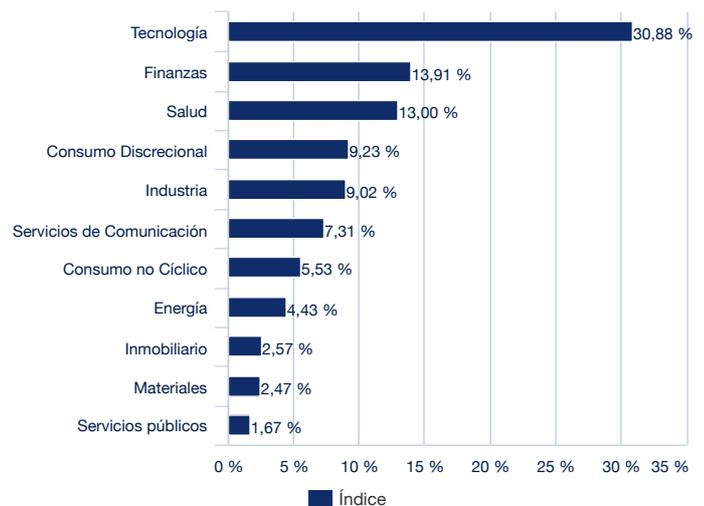
## Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



## Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

Línea	% de activos (índice)
MICROSOFT CORP	6,59%
APPLE INC	4,99%
NVIDIA CORP	4,82%
AMAZON.COM INC	3,33%
ALPHABET INC CL C	2,73%
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,92%
ELI LILLY & CO	1,47%
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,20%
TEXAS INSTRUMENTS	1,08%
HOME DEPOT INC	1,06%
<b>Total</b>	<b>29,18%</b>

## Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



RENTA VARIABLE ■

**Menciones legales**

Documento de carácter publicitario, simplificado y no contractual. Las características principales del fondo se especifican en su documentación jurídica, disponible en el sitio web de la AMF (organismo regulador de los mercados financieros en Francia) o por simple demanda ante la sede social de la sociedad gestora. Antes de suscribir cualquier fondo se le facilitará la documentación jurídica del mismo. La duración del fondo es ilimitada. Invertir implica riesgos: los valores de las participaciones o de las acciones de las IICVM están sujetas a las fluctuaciones del mercado, de modo que las inversiones realizadas pueden variar al alza y a la baja. Por consiguiente, los suscriptores de IICVM pueden perder todo o parte del capital inicialmente invertido. Previamente a cualquier suscripción, es responsabilidad de las personas interesadas por una IICVM asegurarse de la compatibilidad de dicha suscripción con la legislación a la que está sujeta y con las consecuencias fiscales de la inversión en cuestión, así como familiarizarse con los documentos reglamentarios en vigor de cada IICVM. Salvo especificación contraria, la fuente de los datos del presente documento es Amundi y la fecha de los datos del presente documento es la indicada en el encabezamiento del documento, bajo la mención INFORME MENSUAL DE GESTIÓN.