

AMUNDI S&P 500 ESG INDEX IU

INFORMES

Comunicación
Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE ■

Datos clave (Fuente : Amundi)

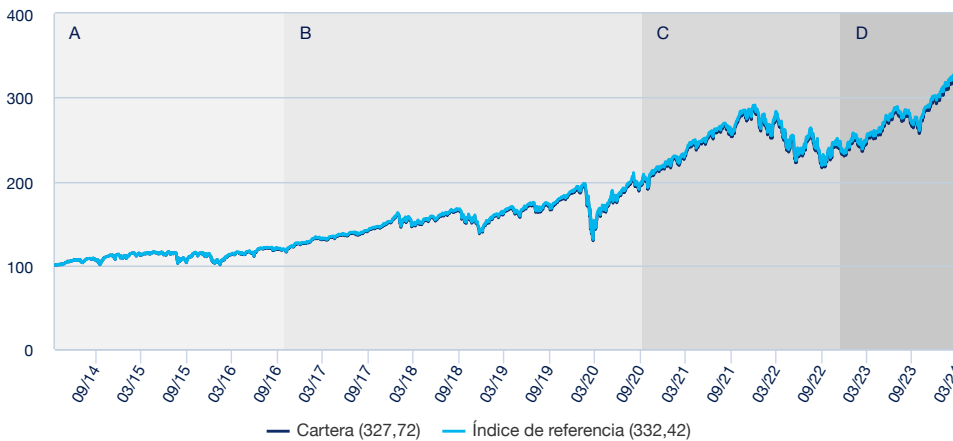
Valor liquidativo : (C) 3 283,68 (USD)
(D) 1 833,69 (USD)
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :
28/03/2024
Activos : 2 135,49 (millones USD)
Código ISIN : (C) LU0996177563
(D) LU0996177647
Código Bloomberg : (C) AIUSIUC LX
(D) AIUSIUD LX
Índice de referencia : 100% S&P 500 ESG+ INDEX

Objetivo de inversión

Amundi S&P 500 ESG trata de replicar lo más exactamente posible el comportamiento del índice S&P 500 ESG+, tanto si la tendencia es al alza como a la baja. Este compartimiento permite a los inversores obtener exposición a valores respetando criterios de sostenibilidad, y al mismo tiempo manteniendo los pesos por sector similares al índice S&P500 excluyendo compañías involucradas en tabaco, carbón térmico y armas controvertidas.

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 10 de mayo de 2005 hasta el 30 de octubre de 2016 del Compartimiento luxemburgués "INDEX EQUITY USA" de la SICAV "AMUNDI FUNDS" gestionada por Amundi Asset Management y absorbida por AMUNDI INDEX S&P 500 el 31 de octubre de 2016.

B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimiento fue el S&P 500

C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimiento es S&P 500 ESG

D : Since the beginning of this period, the reference indicator of the Sub-Fund is S&P 500 ESG+ Index

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	11,63%	16,84%	19,91%
Volatilidad del índice	11,60%	16,77%	19,84%
Tracking Error	0,13%	0,15%	0,17%
Ratio de Sharpe	2,09	0,53	0,65
Ratio de información	-1,25	-0,84	-0,73

* 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

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	-	-	17/04/2014
Cartera	10,17%	3,29%	10,17%	29,76%	42,10%	102,52%	-	-	227,72%
Índice	10,21%	3,30%	10,21%	29,93%	42,56%	103,62%	-	-	232,42%
Diferencia	-0,04%	-0,01%	-0,04%	-0,17%	-0,47%	-1,10%	-	-	-4,69%

Rentabilidades anuales * (Fuente: Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Cartera	27,52%	-18,26%	31,92%	16,22%	31,70%	-5,90%	20,93%	10,80%	0,60%	-
Índice	27,70%	-18,16%	31,95%	16,31%	31,82%	-5,75%	21,10%	11,23%	0,75%	-
Diferencia	-0,18%	-0,11%	-0,03%	-0,09%	-0,12%	-0,15%	-0,17%	-0,43%	-0,15%	-

* 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.

RENTA VARIABLE ■

Conozca al Equipo



Isabelle Lafargue

Responsable Gestión Índice & Multiestrategias –
Fondos Regionales



Pierre Navarre

Gestor de cartera



Salah Benaissa

Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

S&P 500 ESG+ (el «Índice») es un índice general ponderado por capitalización de mercado que mide la rentabilidad de los valores que cumplan los criterios de sostenibilidad y que mantengan una ponderación total del grupo industrial similar al del S&P 500 (el «Índice padre»). El S&P 500 es un índice representativo de los principales valores que se negocian en Estados Unidos.

Características (Fuente : Amundi)

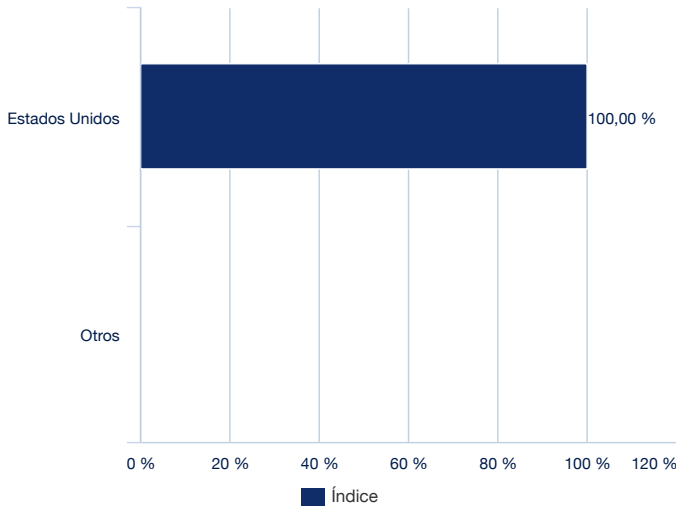
Clase de activo : **Renta variable**
Exposición : **Norteamérica**

total de valores : **306**

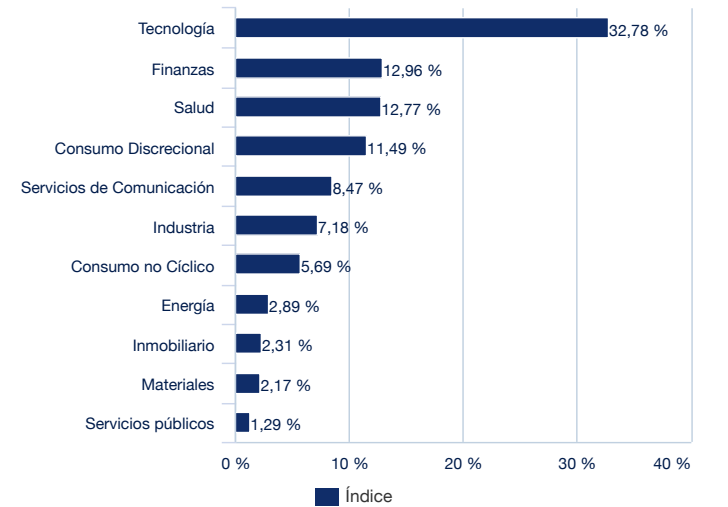
Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)
MICROSOFT CORP	9,61%
APPLE INC	7,65%
NVIDIA CORP	6,86%
AMAZON.COM INC	5,07%
ALPHABET INC CL A	2,73%
ALPHABET INC CL C	2,31%
ELI LILLY & CO	1,91%
JPMORGAN CHASE & CO	1,78%
TESLA INC	1,50%
EXXON MOBIL CORP	1,42%
Total	40,84%

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Comentario de gestión

Los datos de Estados Unidos publicados en marzo confirman 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. En los mercados, las rentabilidades de los bonos siguen orientadas al alza y la renta variable ha continuado apreciándose. 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).

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%).

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	USD
Clasificación	Non applicable
Asignación de los resultados	(C) Participaciones de Capitalización (D) Distribución
Código ISIN	(C) LU0996177563 (D) LU0996177647
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.