AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION - IE

INFORMES

Comunicación Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE

Datos clave (Fuente : Amundi)

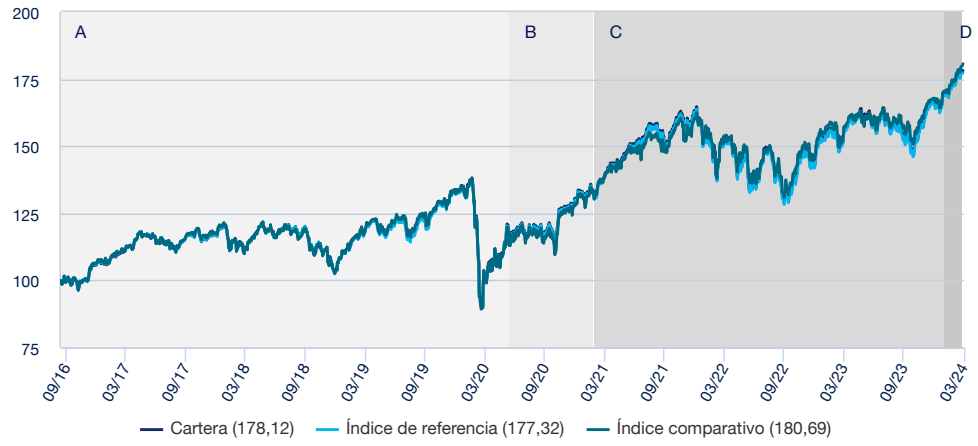
Valor liquidativo : **1 781,18 (EUR)**
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado : **28/03/2024**
Activos : **146,62 (millones EUR)**
Código ISIN : **LU1437019992**
Código Bloomberg : **AIEEIEC LX**
Índice de referencia : **100% MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED FILTERED INDEX**
Indice comparativo : **MSCI Europe**

Objetivo de inversión

El objetivo de este Subfondo es replicar la rentabilidad del MSCI Europe Climate Paris Aligned Filtered Index (el «Índice») y minimizar el error de seguimiento entre el valor liquidativo del Subfondo y la rentabilidad del Índice.

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

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



A : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento fue el MSCI Europe Low Carbon Leaders Index.
B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento fue el índice MSCI EUROPE CLIMATE CHANGE.
C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento es el índice MSCI Europe Climate Change CTB Select.
D : Since the beginning of this period, the reference indicator of the sub-fund is MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered Net EUR Index.

Indicador de Riesgo *(Fuente: Fund Admin)*

1 2 3 **4** 5 6 7

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	11,98%	14,29%	18,26%
Volatilidad del índice	11,79%	14,28%	18,22%
Tracking Error	0,91%	0,88%	0,87%
Ratio de Sharpe	0,81	0,49	0,44
Ratio de información	-0,13	0,00	0,10

* 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 29/12/2023	1 mes 29/02/2024	3 meses 29/12/2023	1 año 31/03/2023	3 años 31/03/2021	5 años 29/03/2019	10 años -	Desde el 12/09/2016
Cartera	6,53%	2,82%	6,53%	13,35%	27,94%	50,90%	-	78,12%
Índice	6,60%	2,76%	6,60%	13,46%	27,95%	50,33%	-	77,32%
Diferencia	-0,07%	0,06%	-0,07%	-0,12%	0,00%	0,57%	-	0,80%
Índice comparativo	-1,10%	-1,13%	-1,10%	-1,44%	-2,36%	-1,57%	-	-2,57%
Índice comparativo	7,63%	3,94%	7,63%	14,79%	30,31%	52,47%	-	80,69%

Rentabilidades anuales * (Fuente: Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Cartera	17,46%	-12,64%	25,82%	-2,15%	29,14%	-12,21%	10,51%	-	-	-
Índice	17,33%	-12,66%	25,69%	-2,12%	28,78%	-12,33%	10,34%	-	-	-
Diferencia	0,12%	0,01%	0,13%	-0,03%	0,36%	0,12%	0,17%	-	-	-
Índice comparativo	15,83%	-9,49%	25,13%	-13,13%	29,12%	-12,70%	10,61%	-	-	-
Índice comparativo	1,63%	-3,15%	0,69%	10,98%	0,02%	0,48%	-0,10%	-	-	-

** Las rentabilidades arriba indicadas cubren períodos 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.*

AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION - IE

INFORMES
Comunicación Publicitaria
31/03/2024

RENTA VARIABLE ■

Conozca al Equipo

Isabelle Lafargue
Responsable Gestión Índice & Multiestrategias – Fondos Regionales

Vincent Masson
Gestor de cartera senior

Jerome Gueguen
Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

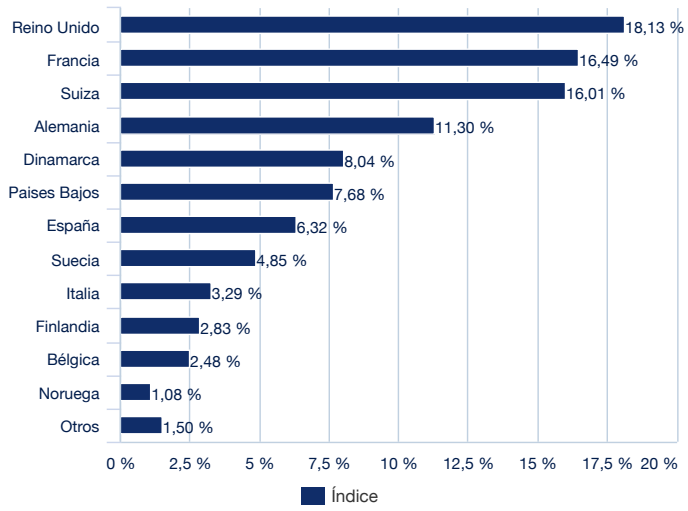
El Índice es un índice bursátil basado en el MSCI Europe Index («Índice principal»), representativo de los valores de gran y mediana capitalización de países de mercados desarrollados de la Unión Económica y Monetaria de la Unión Europea (el «Índice principal»). El Índice está diseñado para ayudar a los inversores que buscan reducir su exposición a los riesgos climáticos físicos y de transición, y que desean buscar oportunidades que surjan de la transición hacia una economía con menos emisiones de carbono, al tiempo que cumplen con los requisitos mínimos de los índices de referencia de la UE armonizados con el Acuerdo de París (EU PAB) en virtud del Reglamento (UE) 2019/2089, por el que se modifica el Reglamento (UE) 2016/1011. El Índice incorpora las recomendaciones del Grupo de Trabajo sobre Divulgaciones Financieras Relacionadas con el Clima (TCFD, por sus siglas en inglés) y se ha diseñado para superar los requisitos mínimos del índice de referencia de la UE armonizado con el Acuerdo de París.

Características (Fuente : Amundi)

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

total de valores : **235**

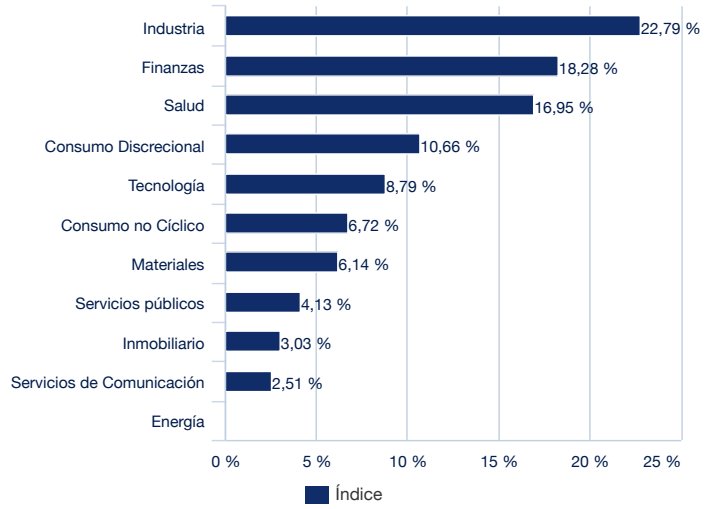
Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)
NOVO NORDISK A/S-B	4,49%
ASML HOLDING NV	3,82%
SCHNEIDER ELECT SE	2,55%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,36%
FERROVIAL SE	2,36%
ABB LTD-REG	2,25%
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,17%
ASTRAZENECA GBP	2,06%
AKZO NOBEL N.V.	1,92%
SAP SE / XETRA	1,89%
Total	**25,89%**

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. También 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%).

Amundi Asset Management, SAS (French : Société par Actions Simplifiée) con un capital de 1 143 615 555 €
Sociedad gestora de carteras autorizada por la AMF N° GP 04000036
Sede social: 91-93, boulevard Pasteur – 75015 París – Francia 437 574 452 RCS París
Material dirigido únicamente a inversores «profesionales».

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	Participaciones de Capitalización
Código ISIN	LU1437019992
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,18% (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, solicitación, 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 SPPICAV 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.