

AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA - AE

INFORMES

Comunicación Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE ■

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : **143,35 (EUR)**
 Fecha de valor liquidativo y activo gestionado : **28/03/2024**
 Activos : **37,16 (millones EUR)**
 Código ISIN : **LU1437019307**
 Código Bloomberg : **AIEGMAE LX**
 Índice de referencia : **100% SCIENTIFIC BETA DEVELOPED MULTI-BETA MULTI-STRATEGY ERC**

Objetivo de inversión

El objetivo es replicar lo mejor posible la evolución del índice de estrategia Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy ERC ("el Índice de estrategia") cualquiera que sea su evolución, tanto al alza como a la baja. El Compartimento tiene por objeto alcanzar un nivel de tracking error del Compartimento y su índice que no sobrepasará normalmente un 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 : 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	Desde el
29/12/2023	29/02/2024	29/12/2023	31/03/2023	31/03/2021	-	01/08/2019	
Cartera	9,24%	4,09%	9,24%	17,75%	26,71%	-	44,20%
Índice	9,44%	4,17%	9,44%	18,35%	28,43%	-	46,99%
Diferencia	-0,20%	-0,08%	-0,20%	-0,60%	-1,72%	-	-2,79%

Rentabilidades anuales* (Fuente : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Cartera	9,52%	-9,15%	28,03%	-2,68%	-
Índice	9,98%	-8,79%	28,48%	-2,23%	-
Diferencia	-0,46%	-0,36%	-0,45%	-0,45%	-

* 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.

Características principales (Fuente : Amundi)

Forma jurídica : **IICVM**
 Fecha de creación : **29/06/2016**
 Elegibilidad : -
 Eligible PEA : **No**
 Asignación de los resultados : **Participaciones de Capitalización**
 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 : **0,50% (realizado)**
 Gastos de salida (máximo) : **0,00%**
 Período mínimo de inversión recomendado : **5 años**
 Comisión de rentabilidad : **No**

Indicadores de Riesgo (Fuente : Fund Admin)

	1 año	3 años	5 años
Volatilidad de la cartera	9,12%	12,03%	-
Volatilidad del índice	9,06%	12,00%	-

* 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%.

RENDA VARIABLE ■

Conozca al Equipo



Lionel Brafman
Responsable Gestión Índice & Multistategy



Marie-Charlotte Lebigue
Lead Portfolio Manager



David Heard
Gestor de cartera suplente

Comentario de gestión

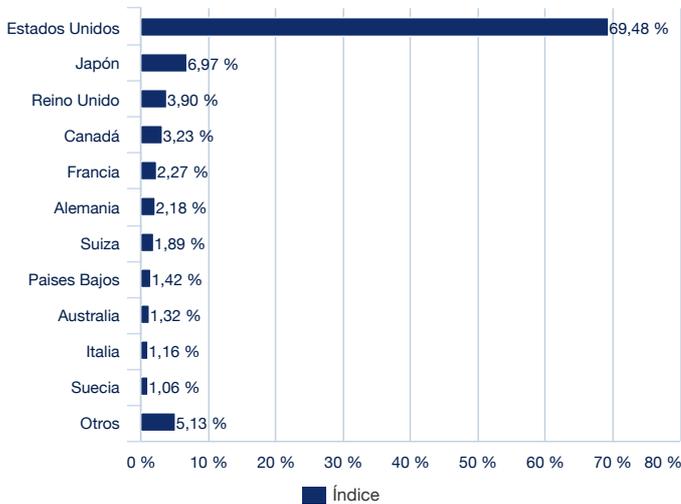
Los datos de Estados Unidos publicados en marzo han confirmado el buen comportamiento de la economía del país. En Europa, señalan una muy ligera mejoría desde una situación de casi estancamiento. En los países emergentes, los indicadores han mostrado algunas divergencias entre regiones. La inflación continúa reduciéndose a ambos lados del Atlántico, aunque de forma más gradual que a finales de 2023. En los mercados, las rentabilidades de los bonos siguen orientadas al alza y la renta variable ha continuado apreciándose. Los mercados de acciones 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 +3,2%. Estados Unidos ha crecido un 3,18%, por debajo de Europa (+3,86%). Los mercados de la zona euro (+4,3%) han evolucionado mejor, con las mayores contribuciones procedentes de Italia (+7,2%) y España (+11,3%). Fuera de la zona euro, el mercado sueco (+1,14%) ha sabido aprovechar la tendencia alcista en marzo. También en los mercados desarrollados, la tendencia positiva del mercado japonés (+3,16%) se ha prolongado este mes. El MSCI Emerging Markets ha progresado (+2,52%), favorecido por la buena evolución de los mercados taiwanés (+7,94%) y surcoreano (+5,26%). 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. En los mercados, las rentabilidades de los bonos siguen orientadas al alza y la renta variable ha continuado apreciándose.

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El Índice replica el rendimiento de 4 subíndices seleccionados y ponderados entre los índices "Scientific Beta" concebidos por Edhec Risk Institute (ERI) en este universo de renta variable de medianas y grandes capitalizaciones de los mercados desarrollados. Estos índices de estrategia que cruzan 4 esquemas de selección de títulos y de 5 estrategias dichas 'S

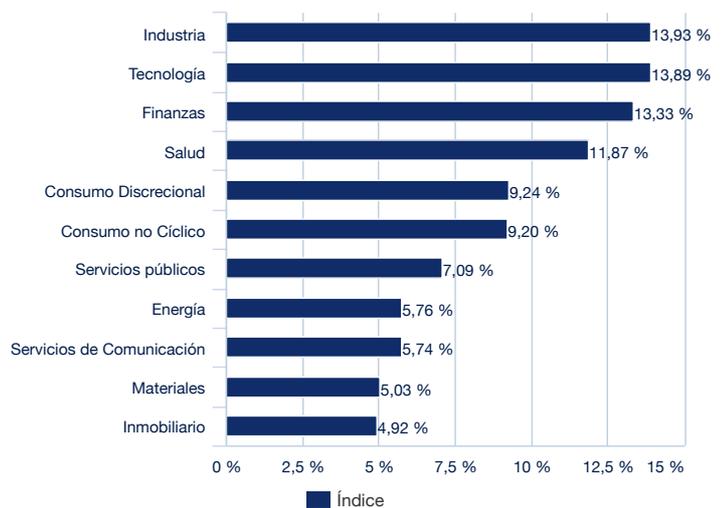
Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

Empresa	% de activos (índice)
MERCK & CO. INC.	0,89%
VERTEX PHARMACEUTIC	0,64%
REGENERON PHARMACEUTICALS	0,52%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0,51%
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	0,50%
WALMART INC	0,49%
SYNOPLYS INC	0,49%
ALPHABET INC CL A	0,43%
EXXON MOBIL CORP	0,43%
WW GRAINGER INC	0,41%
Total	5,30%

Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



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.