

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI - IE

RENTA VARIABLE ■

INFORMES

Comunicación
Publicitaria

28/02/2022

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : (C) 1 474,15 (EUR)
(D) 1 384,88 (EUR)
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :
28/02/2022
Activos : 3 599,02 (millones EUR)
Código ISIN : (C) LU1861136320
(D) LU1861136593
Código Bloomberg : (C) AMIEUIE LX
(D) AMMESEI LX
Índice de referencia :
100% MSCI EUROPE SRI FILTERED PAB

Objetivo de inversión (Fuente : Amundi)

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI busca replicar, de la forma más precisa posible, la rentabilidad del índice MSCI Europe SRI filtered Ex Fossil Fuel Index (Total return index), tanto al alza como a la baja. Este compartimiento permite a los inversores beneficiarse de una exposición a valores de capitalización grande o mediana con rating ESG alto dentro del mercado de renta variable de Europa. Compañías involucradas en alcohol, tabaco, juegos de azar, armas militares, energía nuclear, entretenimiento para adultos, armas de fuego civiles, carbón térmico, organismos genéticamente modificados, producción y reservas de petróleo, gas y combustibles fósiles son excluidas.

Perfil de riesgo y rentabilidad (Fuente: Fund Admin)



➡ A riesgo más bajo, rentabilidad potencialmente más baja

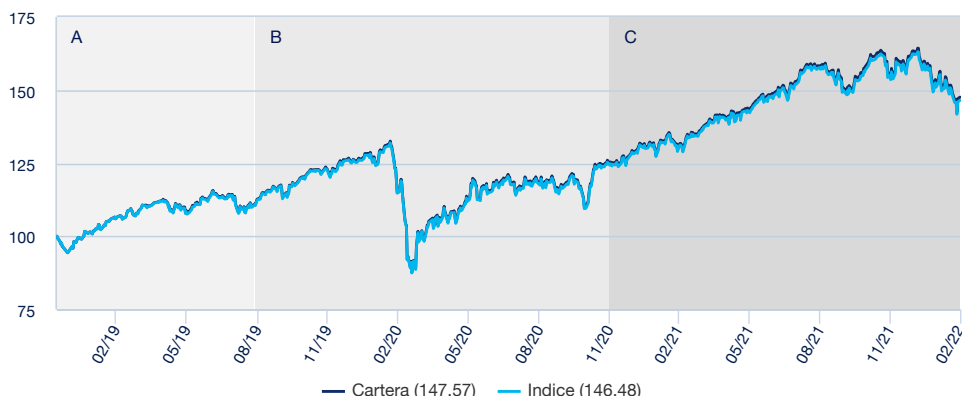
➡ A riesgo más alto, mayor rentabilidad potencial

La categoría más baja no significa "sin riesgo". La categoría de riesgo asociado a este fondo no está garantizada y podrá evolucionar en el tiempo.

« Los valores liquidativos técnicos pueden calcularse y publicarse para cualquier día natural (excluidos los sábados y domingos) que no sea un día hábil ni un día de transacciones. Estos valores liquidativos técnicos son meramente indicativos y no constituirán la base para la compra, el cambio, el reembolso o la transferencia de acciones.»

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 Compartimiento fue el índice MSCI Europe SRI
B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimiento fue el índice MSCI Europe SRI 5% Issuer Capped
C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimiento es el índice MSCI Europe SRI Filtered ex Fossil Fuels

Rentabilidades* (Fuente : Fund Admin)

	Desde el	1 mes	3 meses	1 año	3 años	5 años	Desde el
	31/12/2021	31/01/2022	30/11/2021	26/02/2021	28/02/2019	-	13/12/2018
Cartera	-9,50%	-4,01%	-4,60%	13,90%	39,06%	-	47,57%
Índice	-9,64%	-4,00%	-4,58%	13,57%	38,08%	-	46,48%
Diferencia	0,14%	-0,01%	-0,02%	0,33%	0,98%	-	1,10%

Rentabilidades anuales* (Fuente : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017
Cartera	26,85%	2,54%	32,90%	-	-
Índice	26,52%	2,45%	32,57%	-	-
Diferencia	0,33%	0,09%	0,33%	-	-

* Las rentabilidades arriba indicadas cubren periodos completos de 12 meses para cada año civil. Las rentabilidades pasadas no presupon 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.

Indicadores de riesgo (Fuente : Amundi)

	1 año	3 años	5 años
Volatilidad de la cartera	10,96%	19,78%	-
Volatilidad del índice	11,12%	19,64%	-
Tracking Error	0,76%	0,76%	-
Cociente de Sharpe	1,28	0,60	-
Ratio de información	0,43	0,35	-

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 & Multistrategy

**Pierre NAVARRE**

Gerente de cartera

**Isabelle Lafargue**

Gerente de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

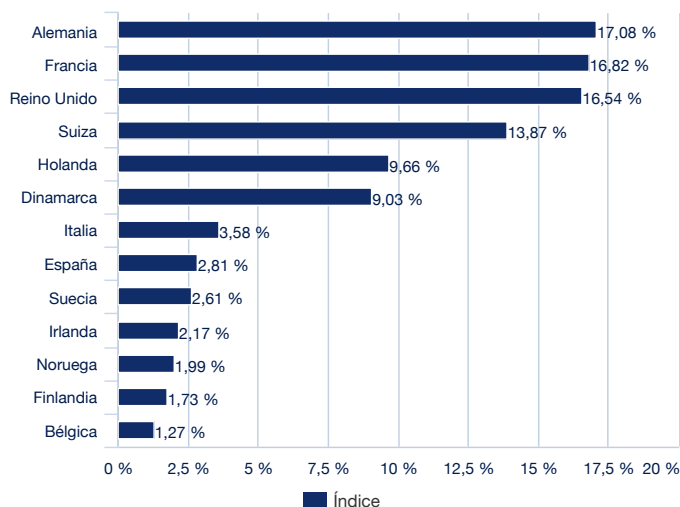
Descripción

MSCI Europe SRI Filtered ex Fossil Fuels es un índice de renta variable basado en el índice MSCI Europe (el «Índice padre»), representativo de las acciones de gran y mediana capitalización de 15 países europeos desarrollados (a septiembre de 2020). El Índice ofrece exposición a sociedades con calificaciones ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) excepcionales y excluye a aquellas sociedades cuyos productos tengan un impacto social o medioambiental negativo.

Características (Fuente : Amundi)

Clase de activo : **Renta variable**
Exposición : **Europa**
Divisa de referencia del índice : **EUR**
Bloomberg Index Ticker : **MXEUSXNE**
total de valores : **114**

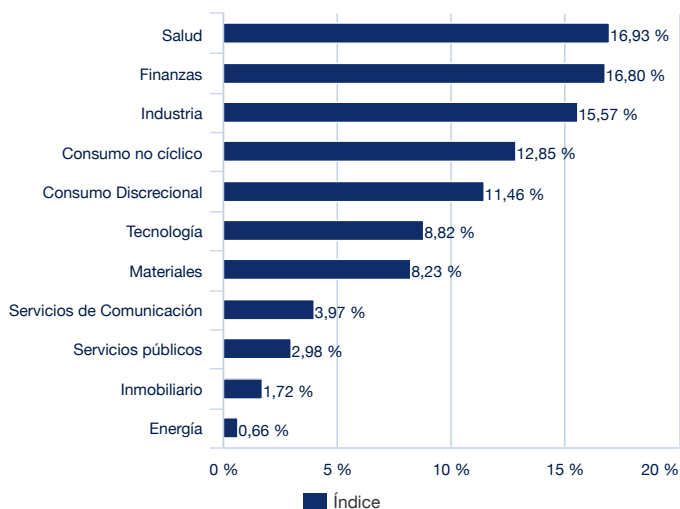
Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Principales líneas del índice

	% de activos (índice)
ROCHE HLDG AG-GENUSS	5,34%
NOVO NORDISK A/S-B NEW	5,00%
SAP SE	4,55%
ASML HOLDING NV	4,28%
L OREAL	4,03%
ALLIANZ SE-REG	3,88%
SCHNEIDER ELECT SE	3,44%
RELX PLC	2,37%
AXA SA	2,18%
ESSILORLUXOTTICA	2,08%
Total	37,16%

Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Comentario de gestión

Fuerte caída del STOXX 600 (-3,4%) en febrero. Los principales índices bursátiles han retrocedido (DAX -6,5%, CAC -4,9%), penalizados por la transformación en guerra del conflicto geopolítico entre Rusia y Ucrania. Pese a las negociaciones iniciadas con Estados Unidos y la UE, Rusia ha decidido concretar sus amenazas invadiendo Ucrania. Como represalia, Estados Unidos y la UE han anunciado una serie de sanciones contra Rusia, como la congelación de sus activos financieros y la exclusión de algunos bancos del país del sistema de transacciones internacionales Swift. Destaca la evolución prácticamente estable del FTSE 100 (-0,1%), beneficiado por su exposición a los sectores de los metales y las minas y de la defensa.

En el frente económico, la inflación sigue acaparando los titulares. En la zona euro, en enero ha alcanzado un nivel récord del 5,1% interanual. En EE.UU., el PIB ha progresado un 7,0% interanual en el 4T de 2021.

En cuanto a los bancos centrales, como se esperaba, el BCE ha mantenido invariada su política monetaria y ha confirmado su intención de reducir sus compras de bonos en los mercados durante los próximos meses. La Fed ha afirmado que no actuará con carácter de urgencia antes de su próxima reunión, prevista para los días 15 y 16 de marzo.

Buena evolución de los sectores indexados con las materias primas, que han progresado con fuerza a lo largo de todo el mes ante los temores relativos a su aprovisionamiento. El barril de Brent ha superado los 100 USD y el WTI se les ha acercado. El precio del acero ha aumentado cerca de un 15%. El sector de los recursos básicos (+8,5%) ha logrado la mayor progresión: los servicios públicos (+1,9%) y la energía (+0,8%) han aprovechado el fuerte encarecimiento de los precios energéticos y el rali de los valores renovables.

RENTA VARIABLE ■

Comentario de gestión

Todo lo contrario ha sucedido con los sectores financieros : los seguros (-7,8%) y la banca (-9,3%) han retrocedido, afectados por las inquietudes macroeconómicas y el descenso de los tipos estadounidenses/alemanes, que han contrarrestado unos resultados de buena factura, al igual que el sector de las ventas minoristas (-10,3%), a pesar de unos resultados con frecuencia mejores de lo previsto.

En este contexto, el MSCI Europe SRI ex Fossil Fuel ha registrado una rentabilidad del -4,00%.

Características principales (Fuente : Amundi)

Naturaleza jurídica	IICVM de Derecho luxemburgués
Normativa UCITS	OICVM
Sociedad gestora	Amundi Luxembourg SA
Sub Delegación Financiera	CACEIS BANK LUXEMBOURG
Custodio	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Auditor Externo	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Fecha de creación	11/09/2018
Divisa de referencia de la clase	EUR
Clasificación	Non applicable
Asignación de los resultados	(C) Participaciones de Capitalización (D) Distribución
Código ISIN	(C) LU1861136320 (D) LU1861136593
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,18% (realizado) - 19/01/2022
Periodo mínimo de inversión recomendado	5 años
Cierre fiscal	Septiembre
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 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. Salvo indicación contraria, la fecha de los datos del presente documento es la indicada bajo la mención RESUMEN MENSUAL DE GESTIÓN, en el encabezamiento del documento.

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.