

AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB - AE

INFORMES

Comunicación
Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE ■

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : **215,95 (EUR)**
 Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :
28/03/2024
 Activos : **1 029,41 (millones EUR)**
 Código ISIN : (C) **LU1861135512**
 (D) **LU1861135603**
 Código Bloomberg : **AIMUSAE LX**
 Índice de referencia :
100% MSCI USA SRI FILTERED PAB

Objetivo de inversión

El objetivo de este Subfondo es reproducir la rentabilidad del MSCI USA SRI Filtered PAB 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 índice MSCI USA SRI
 B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento fue el índice MSCI USA SRI 5 % Issuer Capped
 C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento es el índice MSCI USA SRI Filtered PAB

Rentabilidades * (Fuente: Fund Admin)

	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	-	12/02/2019
Cartera	7,74%	2,07%	7,74%	21,80%	40,97%	103,88%	-	113,60%
Índice	7,76%	2,08%	7,76%	22,15%	42,35%	106,65%	-	116,48%
Diferencia	-0,02%	-0,01%	-0,02%	-0,35%	-1,38%	-2,77%	-	-2,88%

Rentabilidades anuales * (Fuente: Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Cartera	21,05%	-15,85%	41,00%	12,97%	-
Índice	21,49%	-15,56%	41,47%	13,30%	-
Diferencia	-0,43%	-0,29%	-0,47%	-0,33%	-

* 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.

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	12,14%	15,87%	18,23%
Volatilidad del índice	12,16%	15,86%	18,21%
Tracking Error	0,18%	0,14%	0,14%
Ratio de Sharpe	1,50	0,67	0,81
Ratio de información	-1,94	-2,69	-2,31

* 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

RENDA VARIABLE ■

Conozca al Equipo



Isabelle Lafargue

Responsable Gestión Índice & Multiestrategias – Fondos Regionales



Quentin Berrou

Lead Portfolio Manager

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice es un índice bursátil basado en el MSCI USA Index, representativo de las acciones de gran y mediana capitalización del mercado estadounidense (el “Índice principal”). El índice proporciona exposición a empresas con excelentes calificaciones medioambientales, sociales y de gobernanza (ESG) y excluye a las empresas cuyos productos tienen un impacto social o medioambiental negativo. El índice pretende representar el rendimiento de una estrategia que pondere de nuevo los valores en función de las oportunidades y los riesgos asociados a la transición climática para cumplir los requisitos mínimos del reglamento sobre índices de referencia de la UE armonizados con el Acuerdo de París (EU PAB).

Características (Fuente : Amundi)

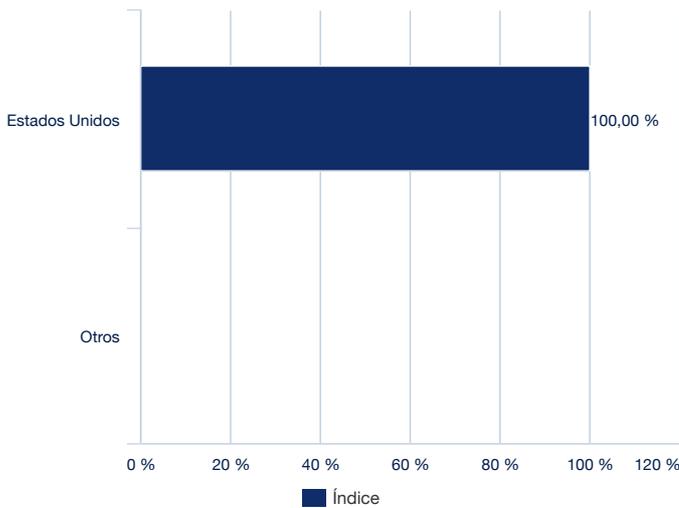
Clase de activo : **Renta variable**

Exposición : **EE.UU.**

Divisa de referencia del índice : **USD**

total de valores : **125**

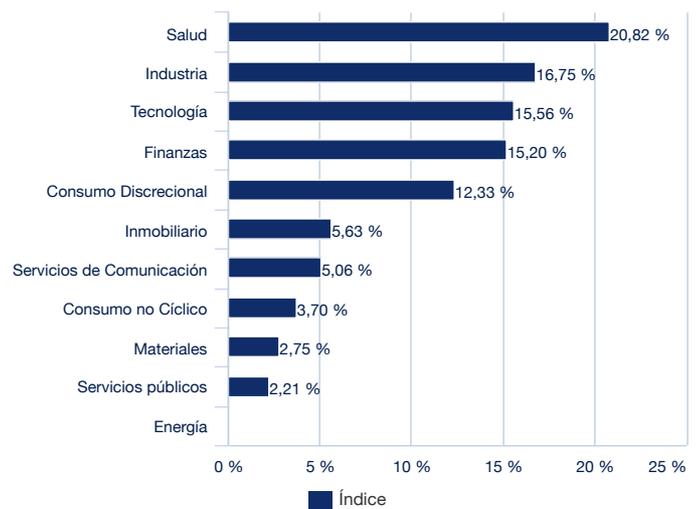
Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)
MICROSOFT CORP	4,93%
TESLA INC	4,26%
HOME DEPOT INC	3,95%
TEXAS INSTRUMENTS	2,70%
DANAHER CORP	2,60%
ADOBE INC	2,51%
WALT DISNEY CO/THE	2,38%
PROLOGIS INC	2,21%
VERIZON COM. INC	2,03%
INTUIT INC	1,89%
Total	29,45%

Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



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).

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
Custodio	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Auditor Externo	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Fecha de creación	11/09/2018
Divisa de referencia de la clase	EUR
Clasificación	-
Asignación de los resultados	(C) Participaciones de Capitalización (D) Distribución
Código ISIN	(C) LU1861135512 (D) LU1861135603
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,35% (realizado) - 08/02/2023
Cierre fiscal	Diciembre

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.