

AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB - UCITS ETF DR

RENTA VARIABLE ■

INFORMES

Comunicación Publicitaria

30/04/2024

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : (C) 51,62 (USD)
(D) 46,10 (USD)
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :
30/04/2024
Activos : 2 010,83 (millones USD)
Código ISIN : (C) LU1861138961
(D) LU2059756754
Replication type : Físico
Índice de referencia :
100% MSCI EM SRI FILTERED PAB

Objetivo de inversión

AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB UCITS ETF busca replicar de la manera más exacta posible el rendimiento del MSCI EMERGING MARKETS SRI filtered PAB Index (Net Total Return) tanto si la tendencia es al alza como a la baja. Este ETF permite una exposición a las grandes y medianas capitalizaciones bursátiles de los países emergentes utilizando un enfoque "best-in-class" que selecciona a las compañías con las mejores calificaciones MSCI ESG. Se excluyen del fondo los emisores que participan en la energía nuclear, las armas nucleares, el tabaco, el alcohol, el juego, las disputas sobre armamento, las armas convencionales, las armas de fuego civiles, el petróleo y el gas, el carbón térmico, los organismos modificados genéticamente, el entretenimiento para adultos o los actores que explotan reservas de combustibles fósiles, y la ponderación de cada componente se limita al 5 %. Además, en materia de transición climática, la ETF cumple los requisitos mínimos del Reglamento de la UE (EU PAB). Si desea más información, consulte el KIID y el folleto del fondo, así como el folleto de los Indexados MSCI, para una descripción completa de los criterios de exclusión.

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 : Hasta el final de este período, el índice de referencia del subfondo era MSCI EMERGING MARKETS SRI Index
B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento fue el índice MSCI EMERGING MARKETS SRI 5% ISSUER CAPPED
C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento es el índice MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB

Rentabilidades* (Fuente : Fund Admin)

Desde el	Desde el 29/12/2023	1 mes 28/03/2024	3 meses 31/01/2024	1 año 28/04/2023	3 años 30/04/2021	5 años 30/04/2019	Desde el 22/01/2019
Cartera	-2,00%	-0,40%	5,08%	-0,66%	-22,37%	-1,82%	3,23%
Índice	-2,00%	-0,40%	5,12%	-0,29%	-21,66%	-0,08%	5,36%
Diferencia	-0,01%	-0,01%	-0,03%	-0,37%	-0,71%	-1,74%	-2,13%

Rentabilidades anuales* (Fuente : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Cartera	1,87%	-18,41%	-1,64%	17,48%	-
Índice	2,25%	-18,26%	-1,27%	17,72%	-
Diferencia	-0,38%	-0,15%	-0,38%	-0,24%	-

Indicadores de riesgo (Fuente: Fund Admin)

	1 año	3 años	Desde el lanzamiento *
Volatilidad de la cartera	15,78%	16,87%	19,97%
Volatilidad del índice	15,75%	16,87%	20,02%
Tracking Error	0,25%	0,46%	0,38%
Ratio de Sharpe	-0,43	-0,68	-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%. Tracking Error

RENTA VARIABLE

* 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.

Conozca al Equipo



Lionel Brafman
Responsable Gestión Índice & Multistrategy



Zhicong Mou
Gestor de cartera



Samy El Malki
Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB es un índice de renta variable basado en el índice MSCI Emerging Markets, representativo de los valores de gran y mediana capitalización de 26 países emergentes (a noviembre de 2021) (el «Índice padre»). 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. Además, el Índice tiene por objetivo replicar la rentabilidad de una estrategia que repondera los valores según las oportunidades y los riesgos asociados a la transición climática para cumplir con los requisitos mínimos del reglamento relativo a los índices de referencia de la UE armonizados con el Acuerdo de París (EU PAB).

Características (Fuente : Amundi)

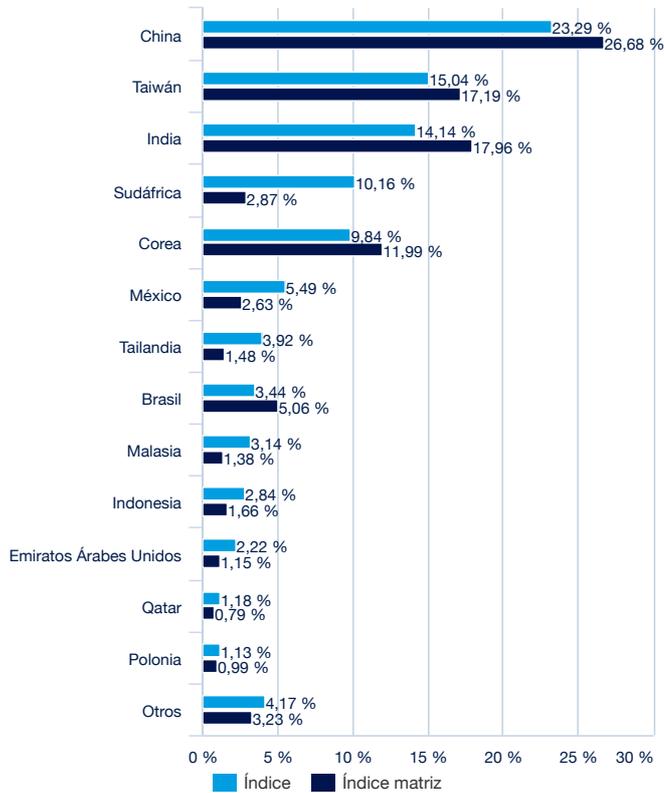
Clase de activo : **Renta variable**
Exposición : **Emergentes**
Divisa de referencia del índice : **USD**
total de valores : **177**

Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

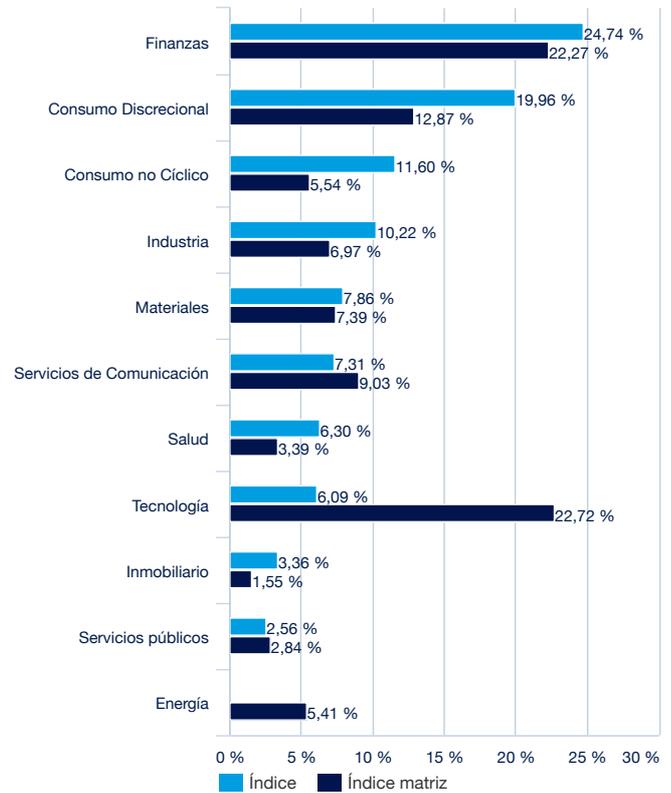
	% de activos (índice)	% de activos (Índice matriz)
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	5,57%	8,29%
MEITUAN-CLASS B	4,85%	1,00%
NASPERS LTD-N SHS	2,72%	0,49%
NETEASE INC	2,50%	0,51%
BANK CENTRAL ASIA PT	2,21%	0,46%
BYD CO LTD-H	2,18%	0,40%
BHARTI AIRTEL LTD	2,00%	0,49%
HINDUSTAN UNILEVER	1,93%	0,30%
FEMSA	1,89%	0,32%
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	1,80%	0,32%
Total	27,65%	12,58%

Índice matriz : **MSCI EMERGING MARKETS**

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



RENDA VARIABLE ■

Índice matriz : MSCI EMERGING MARKETS

Índice matriz : MSCI EMERGING MARKETS

Inversión Socialmente Responsable (ISR)

El ISR traduce los objetivos del desarrollo sostenible en las decisiones de inversiones añadiendo los criterios Medioambientales, Sociales y de Gobernanza (ESG) además de los criterios financieros tradicionales.

Evaluación por criterio ESG (Fuente : Amundi)

	índice	Índice matriz
Calificación general	7,20	5,74
Medio ambiente	6,66	5,70
Social	5,53	5,15
Gobernanza	5,28	4,65

Índice matriz : MSCI EMERGING MARKETS

Criterios ESG

Los criterios son criterios extra-financieros utilizados para evaluar las prácticas medioambientales, sociales y de gobernanza de las empresas.

Los riesgos y oportunidades medioambientales, sociales y de gobernanza se clasifican por grandes tendencias (por ejemplo, el cambio climático, la escasez de recursos, los cambios demográficos), así como por la naturaleza de las operaciones de la empresa.

Las puntuaciones siguen una escala de 0 a 10, siendo 10 la mejor nota.

«E» de Entorno o medio ambiente (cambio climático, recursos naturales, contaminación y residuos y oportunidades medioambientales)

«S» de Social (recursos humanos, fiabilidad de los productos, oposición de los grupos de interés y oportunidades sociales)

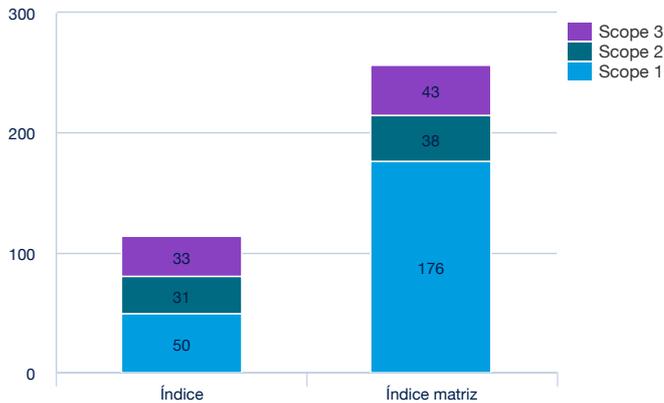
«G» de Gobernanza (gobierno corporativo y comportamiento de la empresa)

Fuente: los datos ESG brutos de las empresas proceden de la agencia MSCI.

Huella de carbono

Huella de carbono por millón de euros invertido

Huella de carbono total en la cartera (índice/índice matriz) : **Índice** 119,57 **Índice matriz** 268,73



Índice matriz : MSCI EMERGING MARKETS

Huella de carbono

Este indicador mide las emisiones de toneladas equivalentes de CO2 (tCO2e) por millón de euros invertidos.

Es un indicador de las emisiones generadas por la inversión en este portafolio.

Definición de los scopes :

- **Scope 1:** Totalidad de las emisiones directas procedentes de fuentes propiedad o bajo control de la empresa.

- **Scope 2:** Totalidad de las emisiones indirectas inducidas por la compra o la producción de electricidad, vapor o calor.

- **Scope 3:** Totalidad de todas las demás emisiones indirectas, previas o posteriores a la cadena de valor. Por motivos de solidez de los datos, en este informe hemos optado por utilizar únicamente una parte del scope 3: las emisiones previas correspondientes a proveedores de primer nivel. Los proveedores de primer nivel son aquellos con los que la empresa mantiene una relación privilegiada y en los que puede influir directamente.

Fuente : Los datos sobre emisiones de carbono proceden de Trucost. Corresponden a las emisiones anuales de las empresas y se expresan en toneladas equivalentes de CO2. Por ejemplo, agrupan los seis gases de efecto invernadero definidos en el Protocolo de Kioto, cuyas emisiones se convierten a potencial de calentamiento global (PRG) en equivalente de CO2.

Etiqueta ISR



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	16/01/2019
Primer fecha de Valoración	22/01/2019
Divisa de referencia de la clase	USD
Clasificación	-
Asignación de los resultados	(C) Participaciones de Capitalización (D) Distribución
Código ISIN	(C) LU1861138961 (D) LU2059756754
Mínimo de suscripción mercado secundario	1 Participación(es)
Valoración	Diaria
Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento	0,25%
Cierre fiscal	Diciembre

Datos de cotización del ETF (Fuente : Amundi)

Sitio	Horarios	Divisa	Mnemo	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
BIVA	-	EUR	EMSRI	EMSRIN MM	-	-	-
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	USD	MSRU	MSRU LN	-	MSRU.L	-
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	MSRG	MSRG LN	-	MSRG.L	-
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	AMEI	AMEI GY	IEMSI	AMEI.DE	IEMSIINAV.PA
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	EMSRI	EMSRI IM	IEMSI	EMSRI.MI	IEMSIINAV.PA
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	EUR	EMSRI	EMSRI FP	IEMSI	EMSRI.PA	IEMSIINAV.PA

Contacto

Contacto ETF venta

Francia & Luxemburgo	+33 (0)1 76 32 65 76
Alemania & Austria	+49 (0) 800 111 1928
Italia	+39 02 0065 2965
Suiza (Alemán)	+41 44 588 99 36
Suiza (Francés)	+41 22 316 01 51
UNITED KINGDOM (Retail)	+44 (0) 20 7 074 9598
UNITED KINGDOM (Instit)	+44 (0) 800 260 5644
Países Bajos	+31 20 794 04 79
Países Nórdicos	+46 8 5348 2271
Hong Kong	+65 64 39 93 50
España	+34 914 36 72 45

Contacto ETF Capital Market

Téléphone	+33 (0)1 76 32 19 93
Bloomberg IB Chat	Capital Markets Amundi ETF
	Capital Markets Amundi HK ETF

Contacto ETF Broker

BNP Paribas	+33 (0)1 40 14 60 01
Kepler Cheuvreux	+33 (0)1 53 65 35 25

Contacto Amundi

Amundi ETF
90 bd Pasteur
CS 21564
75 730 Paris Cedex 15 - France
Hotline : +33 (0)1 76 32 47 74
info@amundiETF.com

Índices Proveedores

AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB (EL «COMPARTIMENTO») NO ESTÁ PATROCINADO, RESPALDADO, VENDIDO O PROMOVIDO POR MSCI INC. («MSCI»), CUALQUIERA DE SUS FILIALES, SUS PROVEEDORES DE INFORMACIÓN O CUALQUIER TERCERO INVOLUCRADO EN, O RELACIONADO CON, COMPILAR O CREAR CUALQUIER ÍNDICE MSCI (COLECTIVAMENTE, LOS «TERCEROS DE MSCI»). LOS ÍNDICES MSCI SON PROPIEDAD EXCLUSIVA DE MSCI Y SON MARCAS DE SERVICIO DE MSCI O SUS FILIALES. LOS ÍNDICES MSCI HAN SIDO LICENCIADOS PARA SU USO PARA CIERTOS FINES POR AMUNDI. NINGUNO DE LOS TERCEROS DE MSCI OTORGA NINGUNA DECLARACIÓN O GARANTÍA, EXPRESA O IMPLÍCITA, AL EMISOR O PROPIETARIOS DE ESTE COMPARTIMENTO O CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD CON RESPECTO A LA DISPONIBILIDAD DE INVERTIR EN LOS COMPARTIMENTOS O EN ESTE COMPARTIMENTO EN PARTICULAR O LA CAPACIDAD DE CUALQUIER ÍNDICE MSCI PARA SEGUIR EL CORRESPONDIENTE RENDIMIENTO DEL MERCADO DE VALORES. MSCI O SUS FILIALES SON LICENCIATARIOS DE CIERTAS MARCAS, MARCAS DE SERVICIO Y NOMBRES COMERCIALES Y DE LOS ÍNDICES MSCI QUE SE DETERMINAN, COMPONEN Y CALCULAN POR MSCI SIN RESPECTO DE AMUNDI O DE ESTE COMPARTIMENTO O DE LOS TITULARES DE ESTE COMPARTIMENTO O DE CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD.

NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI TIENE LA OBLIGACIÓN DE CONSIDERAR LAS NECESIDADES DE AMUNDI, DE LOS TITULARES DE ESTE SUBFONDO NI DE NINGUNA OTRA PERSONA O ENTIDAD EN CONSIDERACIÓN A LA HORA DE DETERMINAR, COMPONER O CALCULAR LOS ÍNDICES MSCI. NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI ES RESPONSABLE NI HA PARTICIPADO EN LA DETERMINACIÓN DE LOS HORARIOS, LOS PRECIOS O LAS CANTIDADES A LOS QUE EMITIR ESTE SUBFONDO. LAS PARTES TAMPOCO HAN TOMADO PARTE PARA DETERMINAR O CALCULAR LA ECUACIÓN NI PARA CONSIDERAR EN QUÉ PODRÍA REEMBOLSARSE ESTE SUBFONDO. ADEMÁS, NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI TIENE NINGUNA OBLIGACIÓN NI RESPONSABILIDAD CON EL EMISOR O CON LOS PROPIETARIOS DE ESTE SUBFONDO, NI CON NINGUNA OTRA PERSONA O ENTIDAD EN RELACIÓN CON ESTE SUBFONDO.

AUNQUE MSCI OBTENDRÁ INFORMACIÓN PARA LA INCLUSIÓN EN O PARA SU USO EN EL CÁLCULO DE LOS ÍNDICES MSCI DESDE FUENTES QUE MSCI CONSIDERA FIABLES, NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI GARANTIZA LA ORIGINALIDAD, LA PRECISIÓN Y/O LA INTEGRIDAD DE NINGÚN ÍNDICE MSCI O DE LOS DATOS INCLUIDOS EN ÉL. NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI REPRESENTA UNA GARANTÍA, EXPLÍCITA O IMPLÍCITA, EN RELACIÓN CON LOS RESULTADOS QUE DEBA OBTENER EL EMISOR DE ESTE SUBFONDO, ASÍ COMO LOS PROPIETARIOS DEL SUBFONDO O CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD QUE HAYA HECHO USO DE UN ÍNDICE MSCI O DE LOS DATOS QUE SE INCLUYEN EN ÉL. NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI TENDRÁ NINGUNA RESPONSABILIDAD POR ERRORES, OMISIONES O INTERRUPCIONES DE O EN RELACIÓN CON UN ÍNDICE MSCI O CON LOS DATOS QUE SE INCLUYEN EN ÉL. ADEMÁS, NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI REPRESENTA GARANTÍAS, EXPLÍCITAS O IMPLÍCITAS, DE NINGÚN TIPO. LAS PARTES DE MSCI, POR EL PRESENTE, RENUNCIAN A TODAS LAS GARANTÍAS DE COMERCIALIZACIÓN Y ADECUACIÓN PARA UN DETERMINADO FIN, EN RELACIÓN CON CADA ÍNDICE MSCI Y CON LOS DATOS QUE SE INCLUYEN EN ÉL. SIN LIMITAR NINGUNO DE LOS PUNTOS ANTERIORES, EN NINGÚN CASO LAS PARTES DE MSCI TENDRÁN NINGUNA RESPONSABILIDAD POR DAÑOS DIRECTOS, INDIRECTOS, ESPECIALES, PUNITIVOS, CONSECUENCIALES O DE OTRO TIPO (INCLUYENDO LA PÉRDIDA DE BENEFICIOS), INCLUSO SI SE NOTIFICA LA POSIBILIDAD DE DICHA DAÑOS.

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.

Cierta información © 2021 MSCI ESG Research LLC. Reproducido con permiso. Aunque los proveedores de información de Amundi, incluidos, sin limitación, MSCI ESG Research LLC y sus filiales (las «Partes ESG»), obtienen datos (la «Información») de fuentes que consideran fiables, ninguna de las Partes ESG garantiza la originalidad, la exactitud ni/o la exhaustividad de los datos contenidos en el presente documento y rechazan expresamente todas las garantías, expresas o implícitas, incluidas las de calidad comercial y de adecuación a un uso particular. La Información sólo puede ser utilizada para su uso interno y no podrá reproducirse ni difundirse de ninguna forma, ni utilizarse como base o componente de ningún instrumento financiero, producto o índice. Además, ninguna Información podrá ser utilizada para determinar qué títulos comprar o vender o cuándo comprarlos o venderlos. Ninguna de las Partes ESG será responsable de los errores u omisiones relacionados con los datos contenidos en el presente documento, ni de posibles daños directos, indirectos, especiales, punitivos, consecutivos u otros daños (incluida la pérdida de beneficios), incluso en caso de notificación de la posibilidad de tales perjuicios.