

# AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB - UCITS ETF DR

INFORMES

Comunicación  
Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE ■

## Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : (C) 82,78 ( EUR )  
(D) 67,21 ( EUR )  
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :  
28/03/2024  
Activos : 3 599,50 ( millones EUR )  
Código ISIN : (C) LU1861137484  
(D) LU2059756598  
Replication type : Físico  
Índice de referencia :  
100% MSCI EUROPE SRI FILTERED PAB

## Objetivo de inversión

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB busca replicar de la manera más exacta posible el rendimiento del MSCI Europe 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 europeas 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 periodo, el indicador de referencia del Compartimento fue el índice MSCI Europe SRI  
B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento fue el índice MSCI Europe SRI 5% Issuer Capped  
C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimento es el índice MSCI Europe SRI Filtered PAB

### 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	Desde el 11/09/2018
<b>Cartera</b>	7,91%	2,68%	7,91%	14,94%	27,43%	60,72%	65,56%
<b>Índice</b>	7,92%	2,67%	7,92%	14,84%	26,84%	59,59%	64,22%
<b>Diferencia</b>	-0,01%	0,01%	-0,01%	0,09%	0,59%	1,13%	1,34%

### Rentabilidades anuales\* (Fuente : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
<b>Cartera</b>	17,37%	-15,62%	26,85%	2,54%	32,89%
<b>Índice</b>	17,29%	-15,73%	26,52%	2,45%	32,57%
<b>Diferencia</b>	0,08%	0,12%	0,33%	0,09%	0,32%

### Indicadores de riesgo (Fuente: Fund Admin)

	1 año	3 años	Desde el lanzamiento *
<b>Volatilidad de la cartera</b>	12,00%	14,39%	17,84%
<b>Volatilidad del índice</b>	12,02%	14,40%	17,85%
<b>Tracking Error</b>	0,11%	0,15%	0,13%
<b>Ratio de Sharpe</b>	0,94	0,48	0,50

\* 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



**Pierre Navarre**  
Gestor de cartera



**Isabelle Lafargue**  
Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice MSCI Europe SRI Filtered PAB es un índice de renta variable basado en el índice MSCI Europe, representativo de los valores de gran y mediana capitalización de 15 países de los mercados desarrollados de Europa (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)

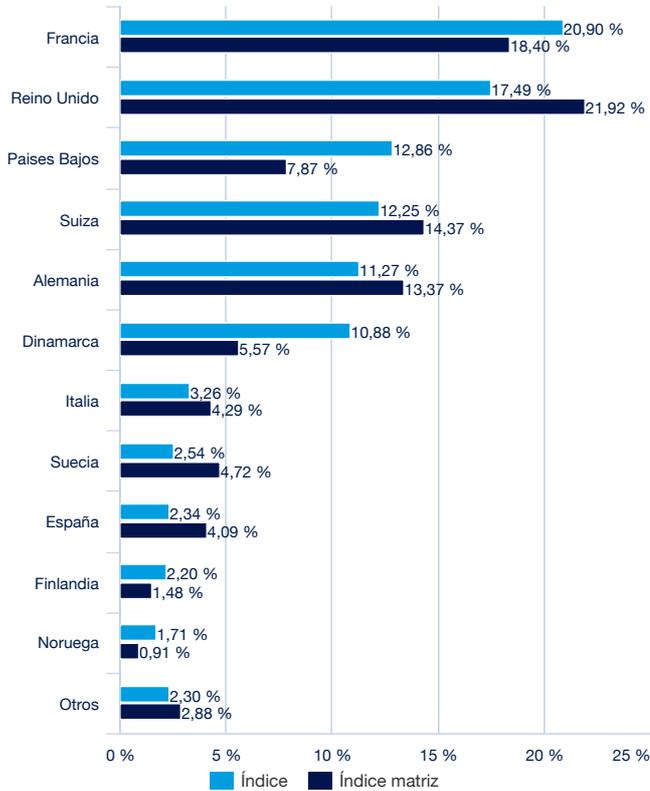
Clase de activo : **Renta variable**  
Exposición : **Europa**  
Divisa de referencia del índice : **EUR**  
total de valores : **115**

Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

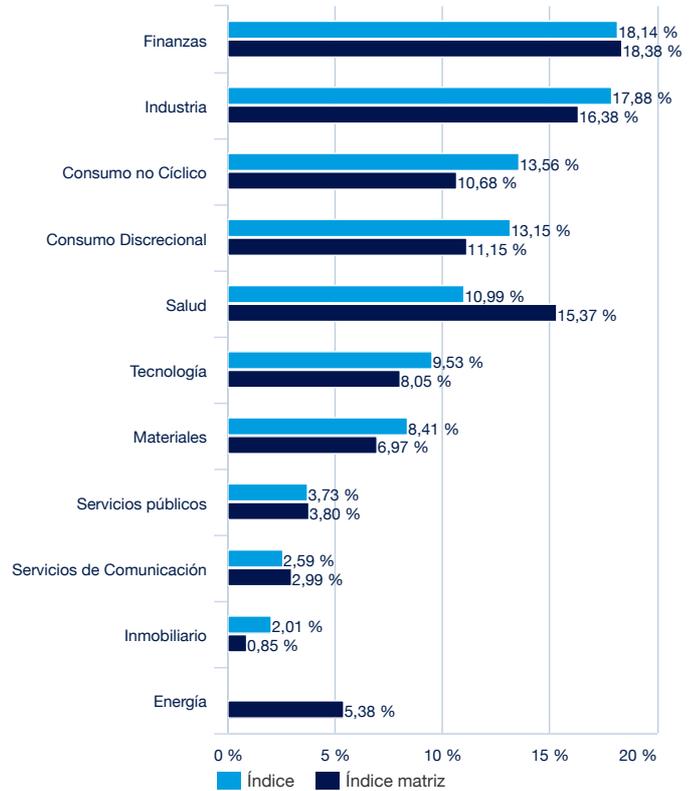
	% de activos (índice)	% de activos (Índice matriz)
ASML HOLDING NV	5,04%	3,52%
SCHNEIDER ELECT SE	5,02%	1,12%
NOVO NORDISK A/S-B	4,99%	3,78%
L OREAL	4,83%	1,03%
HERMES INTERNATIONAL	3,40%	0,73%
RELX PLC	3,11%	0,74%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3,00%	0,72%
AXA SA	2,61%	0,62%
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,52%	0,60%
CRH PLC UK	2,09%	0,54%
<b>Total</b>	<b>36,61%</b>	<b>13,41%</b>

Índice matriz : **MSCI EUROPE**

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



RENDA VARIABLE ■

Índice matriz : **MSCI EUROPE**

Índice matriz : **MSCI EUROPE**

**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
<b>Calificación general</b>	9,03	7,87
<b>Medio ambiente</b>	7,26	6,84
<b>Social</b>	5,93	5,40
<b>Gobernanza</b>	7,08	6,36

Índice matriz : **MSCI EUROPE**

**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)

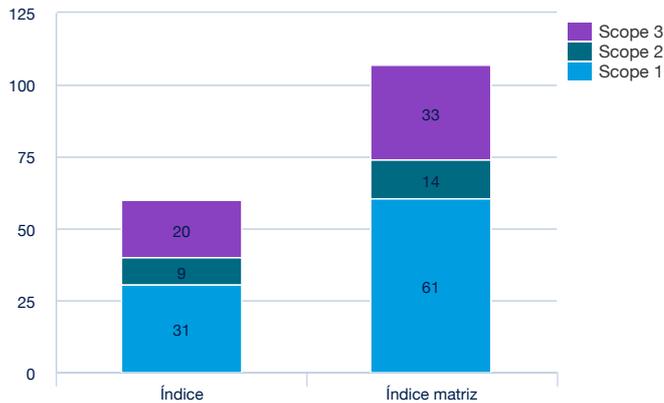
«**G**» de **Gobernanza** (gobierno corporativo y comportamiento de la empresa)

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 60,61 Índice matriz 108,51**



Índice matriz : **MSCI EUROPE**

**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
Custodio	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Auditor Externo	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Fecha de creación	11/09/2018
Primer fecha de Valoración	11/09/2018
Divisa de referencia de la clase	EUR
Clasificación	Non aplicable
Asignación de los resultados	(C) Participaciones de Capitalización (D) Distribución
Código ISIN	(C) LU1861137484 (D) LU2059756598
Mínimo de suscripción mercado secundario	1 Participación(es)
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,18% ( realizado ) - 08/02/2023
Cierre fiscal	Diciembre

## Datos de cotización del ETF (Fuente : Amundi)

Sitio	Horarios	Divisa	Mnemo	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
BIVA	-	EUR	EUSRI	EUSRIN MM	-	-	-
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	USD	ESRU	ESRU LN	-	ESRU.L	-
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	ESRG	ESRG LN	-	ESRG.L	-
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	EUSRI	EUSRI IM	IEUSRI	EUSRI.MI	IEUSRIINAV.PA
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	MIVB	MIVB GY	IEUSRI	MIVB.DE	IEUSRIINAV.PA
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	EUR	EUSRI	EUSRI FP	IEUSRI	EUSRI.PA	IEUSRIINAV.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 EUROPE 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 DICHOS 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.