

# AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB - UCITS ETF DR - HEDGED GBP

RENTA VARIABLE ■

INFORMES

Comunicación Publicitaria

30/04/2024

## Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : **184,48 ( GBP )**  
 Fecha de valor liquidativo y activo gestionado : **30/04/2024**  
 Activos : **527,55 ( millones GBP )**  
 Código ISIN : **LU1646359619**  
 Replication type : **Físico**  
 Índice de referencia : **100% MSCI JAPAN SRI FILTERED PAB 100% HEDGED TO GBP**

## Objetivo de inversión

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB UCITS ETF DR busca replicar de la manera más exacta posible el rendimiento del MSCI Japan SRI Filtered PAB Index (Net Total Return) tanto si la tendencia es al alza como a la baja y tiene cobertura mensual del riesgo de divisa en EUR. Este ETF permite una exposición a las acciones de compañías japonesas de grandes y medianas capitalizaciones bursátiles 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)



### 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 -	5 años -	Desde el 18/11/2022
<b>Cartera</b>	7,22%	-1,83%	0,76%	18,55%	-	-	25,55%
<b>Índice</b>	7,41%	-1,71%	1,02%	18,90%	-	-	26,11%
<b>Diferencia</b>	-0,19%	-0,12%	-0,26%	-0,35%	-	-	-0,56%

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

	2023	2022	2021	2020	2019
<b>Cartera</b>	23,69%	-	-	-	-
<b>Índice</b>	23,99%	-	-	-	-
<b>Diferencia</b>	-0,30%	-	-	-	-

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

	1 año	3 años	Desde el lanzamiento *
<b>Volatilidad de la cartera</b>	14,88%	-	14,15%
<b>Volatilidad del índice</b>	14,91%	-	14,16%
<b>Tracking Error</b>	0,32%	-	0,32%
<b>Ratio de Sharpe</b>	0,83	-	0,82

\* 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

\* 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.

RENTA VARIABLE ■

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice MSCI Japan SRI Filtered PAB es un índice de renta variable basado en el índice MSCI Japan, representativo de los valores de gran y mediana capitalización del mercado japonés (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)

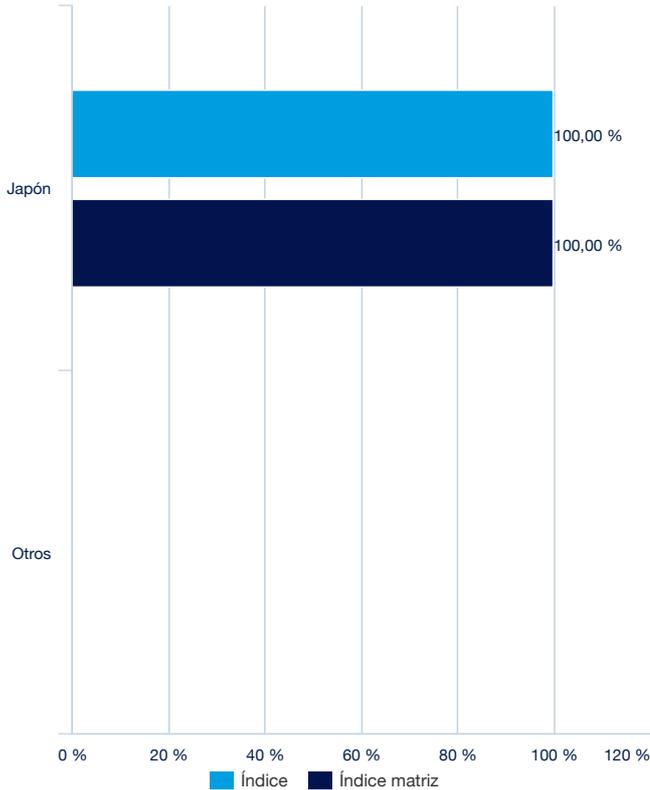
Clase de activo : **Renta variable**  
Exposición : **Japón**  
Divisa de referencia del índice : **JPY**  
total de valores : **46**

Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)	% de activos (Índice matriz)
HOYA CORP	5,15%	1,09%
SONY GROUP CORP (JT)	4,91%	2,77%
FANUC CORP	4,85%	0,74%
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	4,84%	1,51%
SUMITOMO MITSUI FINAN	4,78%	1,92%
DAIKIN INDUSTRIES LTD	4,28%	0,96%
ADVANTEST	3,75%	0,64%
KDDI CORP	3,52%	1,11%
ORIENTAL LAND CO LTD	3,50%	0,80%
HITACHI LTD	3,44%	2,28%
<b>Total</b>	<b>43,01%</b>	<b>13,81%</b>

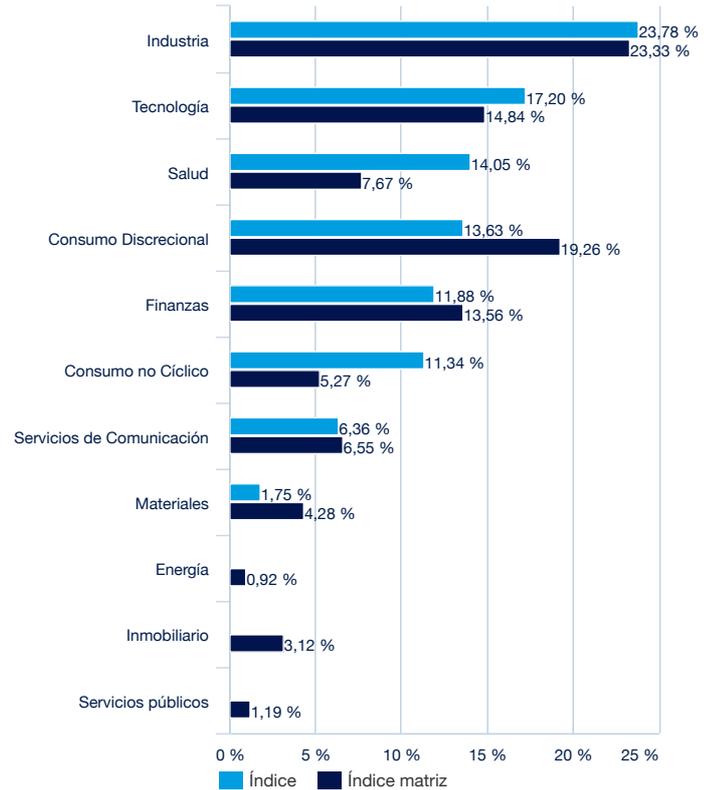
Índice matriz : **MSCI JAPAN**

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Índice matriz : **MSCI JAPAN**

Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Índice matriz : **MSCI JAPAN**

RENTA VARIABLE ■

**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>	8,71	7,32
<b>Medio ambiente</b>	6,92	6,13
<b>Social</b>	6,13	5,55
<b>Gobernanza</b>	6,06	5,62

Índice matriz : **MSCI JAPAN**

**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**

	Índice	Índice matriz
Huella de carbono total en la cartera (índice/índice matriz) :	53,10	110,86

**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.

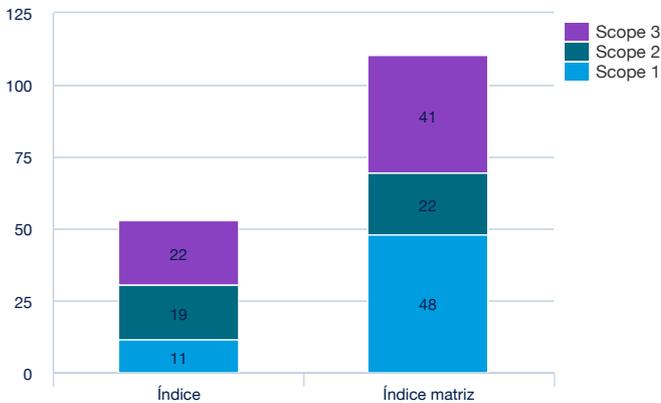
**Definición de los scopes :**

- **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.



Índice matriz : **MSCI JAPAN**

**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	18/11/2022
Primer fecha de Valoración	18/11/2022
Divisa de referencia de la clase	GBP
Clasificación	-
Asignación de los resultados	Participaciones de Capitalización
Código ISIN	LU1646359619
Mínimo de suscripción mercado secundario	1 Participación(es)
Valoración	Diaria
Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento	0,20%
Cierre fiscal	Diciembre

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

Sitio	Horarios	Divisa	Mnemo	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	JPXX	JPXX LN	JPXXIV	JPXX.L	JPXXINAV=SOLA

**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

## RENTA VARIABLE ■

**Índices Proveedores**

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB (EL "SUBFONDO") NO ESTÁ PATROCINADO, RESPALDADO, VENDIDO NI PROMOCIONADO POR MSCI INC. ("MSCI"), NINGUNA DE SUS AFILIADAS, NINGUNO DE SUS PROVEEDORES DE INFORMACIÓN O TERCEROS IMPLICADOS EN, O RELACIONADO CON, COMPILACIÓN O CREACIÓN DE CUALQUIER ÍNDICE MSCI (COLECTIVAMENTE, LAS "PARTES MSCI"). LOS ÍNDICES MSCI SON PROPIEDAD EXCLUSIVA DE MSCI Y SON MARCAS DE SERVICIO DE MSCI O SUS AFILIADOS. LOS ÍNDICES MSCI TIENEN LICENCIA DE USO PARA DETERMINADOS FINES POR PARTE DE AMUNDI. NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI HACE NINGUNA DECLARACIÓN O GARANTÍA, EXPRESA O IMPLÍCITA, AL EMISOR O A LOS PROPIETARIOS DE ESTE SUBFONDO NI A CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD CON RESPECTO A LA CONVENIENCIA DE INVERTIR EN SUBFONDO EN GENERAL O EN ESTE SUBFONDO PARTICULAR O EL CAPACIDAD DE CUALQUIER ÍNDICE MSCI PARA SEGUIR EL CORRESPONDIENTE DESEMPEÑO DEL MERCADO DE VALORES. MSCI O SUS AFILIADOS SON LOS LICENCIANTES DE DETERMINADAS MARCAS COMERCIALES, MARCAS DE SERVICIO Y NOMBRES COMERCIALES Y DE LOS ÍNDICES MSCI QUE DETERMINA, COMPONE Y CALCULA POR MSCI SIN RESPECTO A AMUNDI O ESTE SUBFONDO O LOS PARTICIPANTES DE ESTE SUBFONDO O CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD.

NINGUNA DE LAS PARTES MSCI TIENE NINGUNA OBLIGACIÓN DE TENER EN CUENTA LAS NECESIDADES DE AMUNDI, DE LOS PARTICIPANTES DE ESTE SUBFONDO O DE CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD AL DETERMINAR, COMPONER O CALCULAR LOS ÍNDICES MSCI. NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI ES RESPONSABLE NI HA PARTICIPADO EN LA DETERMINACIÓN DEL MOMENTO, LOS PRECIOS O LAS CANTIDADES DE ESTE SUBFONDO A EMITIR O EN LA DETERMINACIÓN O CÁLCULO DE LA ECUACIÓN O LA CONSIDERACIÓN EN LA QUE ESTE SUBFONDO ES REDIMIBLE. ADEMÁS, NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI TIENE NINGUNA OBLIGACIÓN O RESPONSABILIDAD ANTE EL EMISOR O LOS PROPIETARIOS DE ESTE SUBFONDO O CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD EN RELACIÓN CON LA ADMINISTRACIÓN, COMERCIALIZACIÓN U OFERTA DE ESTE SUBFONDO.

AUNQUE MSCI OBTENDRÁ INFORMACIÓN PARA SU INCLUSIÓN O USO EN EL CÁLCULO DE LOS ÍNDICES MSCI DE FUENTES QUE MSCI CONSIDERA CONFIABLES, NINGUNA DE LAS PARTES MSCI GARANTIZA LA ORIGINALIDAD, EXACTITUD Y/O LA INTEGRIDAD DE CUALQUIER ÍNDICE MSCI O CUALQUIER DATO INCLUIDO EN ESTO. NINGUNA DE LAS PARTES MSCI OFRECE NINGUNA GARANTÍA, EXPRESA O IMPLÍCITA, EN CUANTO A LOS RESULTADOS QUE OBTENDRÁN EL EMISOR DEL SUBFONDO, LOS PROPIETARIOS DEL SUBFONDO O CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD, DEL USO DE CUALQUIER ÍNDICE MSCI O CUALQUIER DATO INCLUIDO EN EL MISMO. NINGUNA DE LAS PARTES MSCI TENDRÁ NINGUNA RESPONSABILIDAD POR CUALQUIER ERROR, OMISIÓN O INTERRUPCIÓN DE O EN RELACIÓN CON CUALQUIER ÍNDICE MSCI O CUALQUIER DATO INCLUIDO EN EL MISMO. ADEMÁS, NINGUNA DE LAS PARTES MSCI OFRECE NINGUNA GARANTÍA EXPRESA O IMPLÍCITA DE NINGÚN TIPO, Y POR EL PRESENTE LAS PARTES MSCI RECHAZAN EXPRESAMENTE TODAS LAS GARANTÍAS DE COMERCIALIZACIÓN E IDONEIDAD PARA UN PROPÓSITO PARTICULAR, CON RESPECTO A CADA ÍNDICE MSCI Y CUALQUIER DATO INCLUIDO EN EL MISMO. SIN LIMITAR LO ANTERIOR, EN NINGÚN CASO, NINGUNA DE LAS PARTES DE MSCI TENDRÁ RESPONSABILIDAD POR CUALQUIER DAÑO DIRECTO, INDIRECTO, ESPECIAL, PUNITIVO, CONSECUENTE O DE CUALQUIER OTRO TIPO (INCLUYENDO LA PÉRDIDA DE BENEFICIOS), INCLUSO SI SE LE NOTIFICA LA POSIBILIDAD DE TALES 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.