

AMUNDI S&P 500 ESG INDEX RE

RENTA VARIABLE ■

INFORMES

Comunicación
Publicitaria

31/05/2024

Datos clave (Fuente : Amundi)

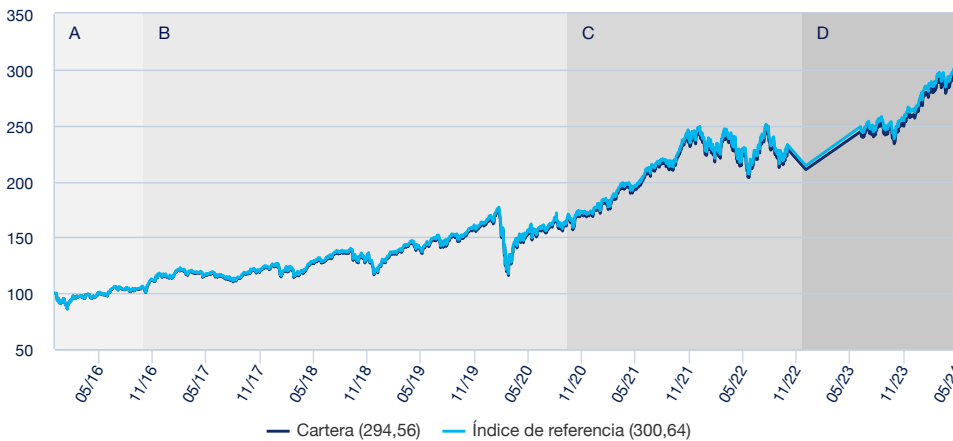
Valor liquidativo : (C) 419,49 (EUR)
(D) 379,82 (EUR)
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :
31/05/2024
Activos : 2 084,39 (millones EUR)
Código ISIN : (C) LU0996179346
(D) LU0996179429
Código Bloomberg : (C) AIUSREC LX
(D) AIUSRED LX
Índice de referencia : 100% S&P 500 ESG+ INDEX

Objetivo de inversión

Amundi S&P 500 ESG trata de replicar lo más exactamente posible el comportamiento del índice S&P 500 ESG+, tanto si la tendencia es al alza como a la baja. Este compartimiento permite a los inversores obtener exposición a valores respetando criterios de sostenibilidad, y al mismo tiempo manteniendo los pesos por sector similares al índice S&P500 excluyendo compañías involucradas en tabaco, carbón térmico y armas controvertidas.

Rentabilidades (Fuente: Fund Admin) - El rendimiento pasado no garantiza los resultados futuros

Evolución de la rentabilidad (base 100) * (Fuente: Fund Admin)



A : Simulación basada en la rentabilidad desde el 10 de mayo de 2005 hasta el 30 de octubre de 2016 del Compartimiento luxemburgués "INDEX EQUITY USA" de la SICAV "AMUNDI FUNDS" gestionada por Amundi Asset Management y absorbida por AMUNDI INDEX S&P 500 el 31 de octubre de 2016.

B : Hasta el final de este periodo, el indicador de referencia del Compartimiento fue el S&P 500

C : Desde el comienzo de este periodo, el indicador de referencia del Compartimiento es S&P 500 ESG

D : Since the beginning of this period, the reference indicator of the Sub-Fund is S&P 500 ESG+ Index

Rentabilidades * (Fuente: Fund Admin)

	Desde el	1 mes	3 meses	1 año	3 años	5 años	10 años	Desde el
	29/12/2023	30/04/2024	29/02/2024	31/05/2023	31/05/2021	31/05/2019	30/05/2014	17/04/2014
Cartera	13,75%	3,85%	4,49%	25,73%	52,56%	115,95%	300,63%	319,68%
Índice	13,89%	3,88%	4,57%	26,02%	53,59%	118,08%	310,61%	330,25%
Diferencia	-0,14%	-0,03%	-0,08%	-0,29%	-1,03%	-2,12%	-9,98%	-10,56%

Rentabilidades anuales * (Fuente: Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Cartera	23,08%	-12,99%	42,55%	5,95%	34,02%	-1,28%	6,15%	13,99%	11,93%	-
Índice	23,38%	-12,79%	42,72%	6,14%	34,28%	-1,03%	6,37%	14,55%	12,22%	-
Diferencia	-0,30%	-0,20%	-0,17%	-0,19%	-0,26%	-0,25%	-0,22%	-0,56%	-0,29%	-

* Las rentabilidades arriba indicadas cubren periodos 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	11,94%	15,26%	17,80%
Volatilidad del índice	11,89%	15,20%	17,74%
Tracking Error	0,15%	0,15%	0,17%
Ratio de Sharpe	1,63	0,86	0,89
Ratio de información	-2,12	-1,67	-1,32

* 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



Isabelle Lafargue

Responsable Gestión Índice & Multiestrategias – Fondos Regionales



Pierre Navarre

Gestor de cartera



Salah Benaissa

Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

S&P 500 ESG+ (el «Índice») es un índice general ponderado por capitalización de mercado que mide la rentabilidad de los valores que cumplan los criterios de sostenibilidad y que mantengan una ponderación total del grupo industrial similar al del S&P 500 (el «Índice padre»). El S&P 500 es un índice representativo de los principales valores que se negocian en Estados Unidos.

Características (Fuente : Amundi)

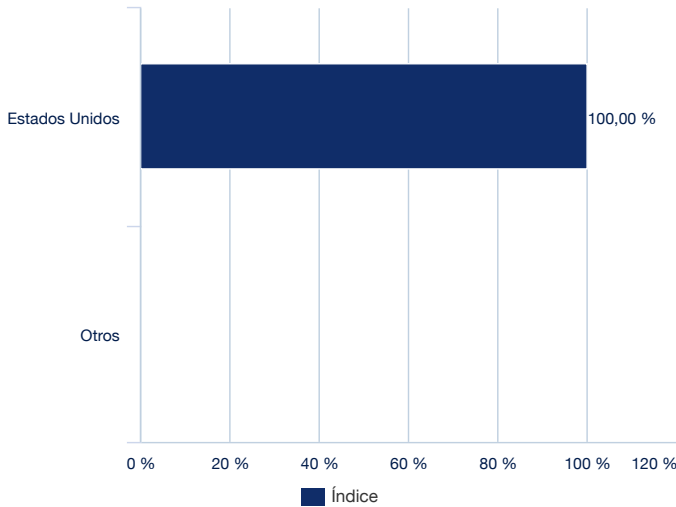
Clase de activo : **Renta variable**
Exposición : **Norteamérica**

total de valores : 317

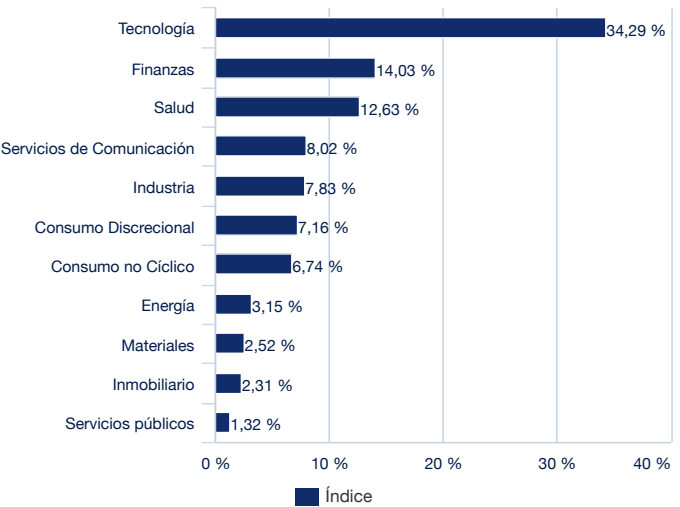
Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)
MICROSOFT CORP	9,69%
APPLE INC	8,77%
NVIDIA CORP	8,51%
ALPHABET INC CL A	3,19%
ALPHABET INC CL C	2,70%
ELI LILLY & CO	2,06%
JPMORGAN CHASE & CO	1,84%
EXXON MOBIL CORP	1,66%
TESLA INC	1,55%
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,44%
Total	41,41%

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Comentario de gestión

Los datos económicos publicados en mayo muestran inflexiones divergentes a ambos lados del Atlántico. En Estados Unidos, la actividad parecía frenarse ligeramente desde una vigorosa dinámica, y la inflación, aunque se mantiene elevada, no ha sorprendido al alza, a diferencia de en los meses anteriores. En la zona euro, el clima de los negocios continúa mejorando lentamente a partir de una situación de fuerte atonía y la inflación se ha reaccelerado ligeramente tras varios meses a la baja. El BCE sigue señalando una primera reducción de tipos en junio, mientras que la Fed no ha precisado la fecha de sus próximos movimientos. En los mercados, la rentabilidad de los bonos ha aumentado y la renta variable ha progresado.

Los indicadores estadounidenses publicados en mayo revelan en su mayoría una moderada desaceleración de la actividad. Asimismo, los índices ISM, que en marzo indicaban una expansión de la actividad, en abril señalan una ligera contracción en la industria y en los servicios. Finalmente, otros datos como las ventas minoristas y la producción industrial de abril se han situado por debajo de las expectativas. Por su parte, los datos de la inflación han sido tranquilizadores ya que se ajustan a las expectativas tras una serie más fuerte de lo previsto en el T1: el índice global de precios ha progresado un 3,4% interanual en abril (+3,5% en marzo) y el índice subyacente, un 3,6% (+3,8%). El alza del índice Core PCE (referencia para la Reserva Federal) ha marcado un 2,8% interanual este mes. Sin embargo, la Reserva Federal ha vuelto a omitir toda precisión sobre el calendario de las rebajas de tipos, indicando que necesita disponer previamente de signos de desinflación. Algunos de sus dirigentes incluso han indicado que no descartan totalmente alzas de tipos adicionales.

Los mercados bursátiles han rebotado en mayo tras unas publicaciones de resultados del T1 tranquilizadoras. El MSCI ACWI ha ganado un 3,5%. Estados Unidos ha progresado un 4,6%, por encima de Europa (+2,3%). Los mercados de la zona euro (+1,7%) han evolucionado algo peor. Países Bajos, Portugal y España han progresado todos un 4,1%, por encima de la zona euro, mientras que Francia se ha situado por debajo, con +0,3%. Fuera de la zona euro, el mercado suizo (+6%) ha logrado claramente los mejores resultados en mayo. El MSCI Emerging Markets ha progresado (+0,2%), impulsado por la buena evolución de los mercados taiwaneses (+4,8%) y chino (+2,1%), aunque ha quedado por debajo del MSCI Monde (+3,8%). Por sectores, en Europa los títulos cíclicos han superado a los defensivos, liderados por las finanzas, la industria y los seguros. La energía y los bienes de consumo cíclico han sido los grandes perdedores este mes. En Europa, los títulos de crecimiento han superado a los de estilo *value*.

En este contexto, el índice ha registrado una rentabilidad mensual del 3,88%.

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	29/06/2016
Divisa de referencia de la clase	EUR
Clasificación	Non applicable
Asignación de los resultados	(C) Participaciones de Capitalización (D) Distribución
Código ISIN	(C) LU0996179346 (D) LU0996179429
Valoración	Diaria
Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento	0,23%
Periodo mínimo de inversión recomendado	5 años
Cierre fiscal	Diciembre
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 SPICAV 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. La fecha de los datos en este documento es la indicada en la parte superior del documento, a menos que se indique lo contrario.

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.