

# Amundi S&P 500 Screened INDEX RE

INFORMES

Comunicación  
Publicitaria

30/06/2026

RENTA VARIABLE ■

## Datos clave (Fuente : Amundi)

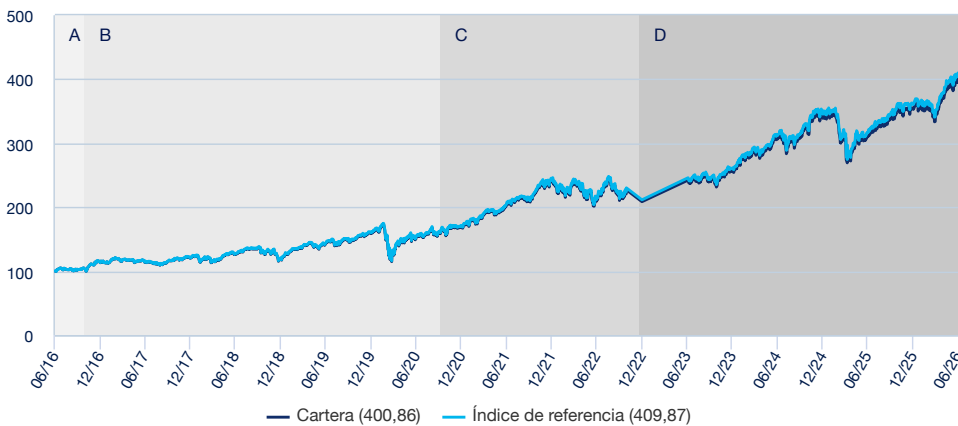
Valor liquidativo : (C) 576,01 ( EUR )  
(D) 515,20 ( EUR )  
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :  
30/06/2026  
Activos : 2 595,82 ( millones EUR )  
Código ISIN : (C) LU0996179346  
(D) LU0996179429  
Código Bloomberg : (C) AIUSREC LX  
(D) AIUSRED LX  
Índice de referencia :  
100% S&P 500 SCORED & SCREENED+ 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   |
|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
|            | 31/12/2025 | 29/05/2026 | 31/03/2026 | 30/06/2025 | 30/06/2023 | 30/06/2021 | 30/06/2016 | 17/04/2014 |
| Cartera    | 13,65%     | 2,90%      | 17,08%     | 28,87%     | 66,02%     | 97,70%     | 300,86%    | 476,27%    |
| Índice     | 13,76%     | 2,92%      | 17,15%     | 29,14%     | 67,16%     | 99,98%     | 309,87%    | 493,58%    |
| Diferencia | -0,12%     | -0,02%     | -0,08%     | -0,26%     | -1,14%     | -2,28%     | -9,01%     | -17,30%    |

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

|            | 2025   | 2024   | 2023   | 2022    | 2021   | 2020   | 2019   | 2018   | 2017   | 2016   |
|------------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Cartera    | 4,12%  | 32,00% | 23,08% | -12,99% | 42,55% | 5,95%  | 34,02% | -1,28% | 6,15%  | 13,99% |
| Índice     | 4,34%  | 32,37% | 23,38% | -12,79% | 42,72% | 6,14%  | 34,28% | -1,03% | 6,37%  | 14,55% |
| Diferencia | -0,22% | -0,37% | -0,30% | -0,20%  | -0,17% | -0,19% | -0,26% | -0,25% | -0,22% | -0,56% |

\* 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 | 9,96% | 14,77% | 15,53% |
| Volatilidad del índice    | 9,94% | 14,74% | 15,48% |
| Tracking Error            | 0,10% | 0,13%  | 0,14%  |
| Ratio de Sharpe           | 2,57  | 1,01   | 0,81   |
| Ratio de información      | -2,51 | -2,03  | -1,87  |

\* 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 : **EE.UU.**

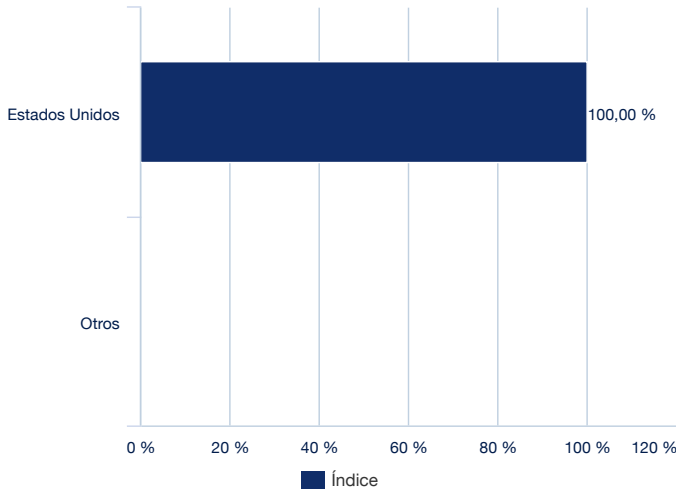
total de valores : **320**

Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

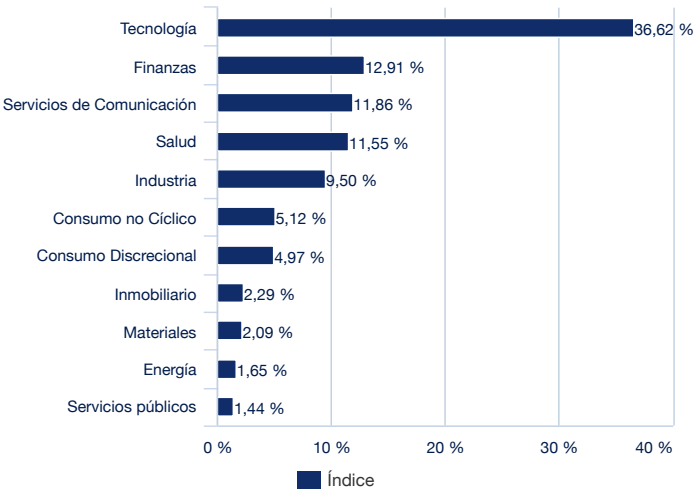
|                         | % de activos (índice) |
|-------------------------|-----------------------|
| NVIDIA CORP             | 12,03%                |
| MICROSOFT CORP          | 6,97%                 |
| ALPHABET INC CL A       | 5,28%                 |
| ALPHABET INC CL C       | 4,23%                 |
| MICRON TECHNOLOGY INC   | 3,29%                 |
| ELI LILLY & CO          | 2,48%                 |
| INTEL CORP              | 1,58%                 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 1,44%                 |
| APPLIED MATERIALS INC   | 1,40%                 |
| LAM RESEARCH CORP       | 1,31%                 |
| <b>Total</b>            | <b>40,02%</b>         |

Solo para fines ilustrativos y no como una recomendación para comprar o vender valores.

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Comentario de gestión

La coyuntura económica mejoró en junio, impulsada por la temática de la IA, que sigue sosteniendo la inversión, pero también por la fuerte caída del precio del petróleo tras el alto el fuego en Irán. La tercera estimación del PIB del primer trimestre confirma un crecimiento del 2,1 %. Los indicadores de consumo se han recuperado, como lo demuestra el repunte de la confianza de los consumidores de la Universidad de Michigan en junio, aunque las variaciones en términos reales, es decir, ajustadas por la inflación, siguen siendo modestas. El mercado laboral continúa sorprendiendo al alza y la tasa de desempleo se mantiene en el 4,3 %, un nivel históricamente bajo. La dinámica industrial sigue siendo sólida, impulsada por los nuevos pedidos, como lo muestra el ISM manufacturero, que alcanzó 54,0 en mayo, su nivel más alto desde 2022. El sector servicios también mantiene una buena orientación, con un ISM servicios al alza en 54,5. Sin embargo, la temática de un crecimiento en K se confirma. La persistencia de altos costos energéticos en los últimos meses ha penalizado la producción industrial y ahora se traslada a los servicios excluyendo la vivienda, especialmente en transporte y salud. La proporción de pymes que desean invertir o contratar en los próximos meses cae además a niveles mínimos, comparables a los observados en 2009 o durante la crisis del Covid. Por el contrario, las inversiones relacionadas con la IA siguen apoyando a los sectores de alta tecnología y electrónica, que continúan en fuerte expansión.

Paradójicamente, el shock energético se está resolviendo progresivamente, pero su impacto inflacionario se intensifica. Los datos de mayo indican un aumento de más del 4 % en el índice de precios al consumidor así como en la inflación PCE. El Core PCE, indicador preferido de la Reserva Federal (Fed), se sitúa en el 3,4 % en mayo, el nivel más alto desde octubre de 2023, mientras que su variación anualizada a seis meses sube al 4 %. Esta presión proviene principalmente de la energía, cuyos precios han subido un 24 % en un año. Este efecto también se refleja en los precios de producción, con un fuerte aumento del +6,5 % en mayo, por encima de las expectativas. Los costos del transporte de mercancías, por su parte, han aumentado un 10,8 % en los últimos tres meses.

En la primera reunión del FOMC presidida por Kevin Warsh, la Fed mantuvo las tasas sin cambios en 3,50–3,75% por unanimidad, declarando que priorizaría la estabilidad de precios. No se dio ninguna orientación prospectiva explícita, pero Warsh anunció el lanzamiento de 5 grupos de trabajo sobre el marco de la política monetaria, señalando una posible evolución más profunda. El mercado anticipa ahora una primera subida de tasas ya en septiembre de 2026.

RENTA VARIABLE

Comentario de gestión

Los mercados de acciones consolidaron ligeramente en junio, con el MSCI ACWI cediendo un -0,9%. La caída de las bolsas estadounidenses y asiáticas fue parcialmente compensada por Europa, que superó (Eurostoxx50 +4,6%) gracias a la perspectiva de una distensión geopolítica en Oriente Medio. En Estados Unidos, el Nasdaq 100 retrocedió un -0,2% en el mes, tras el fuerte repunte de abril y mayo en los que los inversores se posicionaron en la temática de la inteligencia artificial. La colocación secundaria de Google y la salida a bolsa de SpaceX, así como de otros actores tecnológicos, concentraron la atención de los inversores. Los 7 Magníficos perdieron más de 2300 mil millones de dólares de capitalización bursátil mientras los inversores se orientan hacia los proveedores de soluciones de IA y los semiconductores. Las bolsas europeas se vieron impulsadas por los sectores sensibles a la coyuntura geopolítica (bancos, fabricantes de automóviles y valores de lujo), que habían sido penalizados por las incertidumbres relacionadas con el conflicto en Oriente Medio y la perturbación de los suministros energéticos. En Asia, Corea y China registraron importantes flujos vendedores con toma de beneficios en los valores tecnológicos. Esta venta masiva fue desencadenada por la decisión de Apple de subir sus precios debido a la escasez de chips de memoria, reavivando los temores sobre los volúmenes.

En este contexto, el índice muestra un rendimiento de +2,92% en el mes.

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                                                          | DELOITTE AUDIT                                            |
| Fecha de creación                                                        | 29/06/2016                                                |
| Divisa de referencia de la clase                                         | EUR                                                       |
| Clasificación                                                            | Non applicable                                            |
| Asignación de los resultados                                             | (C) Participaciones de Capitalización<br>(D) Distribución |
| Código ISIN                                                              | (C) LU0996179346<br>(D) LU0996179429                      |
| Valoración                                                               | Diaria                                                    |
| Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento | 0,25%                                                     |
| Periodo mínimo de inversión recomendado                                  | 5 años                                                    |
| Cierre fiscal                                                            | Septiembre                                                |
| Código CNMV                                                              | -                                                         |

## RENTA VARIABLE ■

## Menciones legales

**Nota sobre la sociedad de gestión del Fondo y el fondo**

Subfondo de SICAV luxemburguesa Amundi Index Solutions (el 'Subfondo' o 'Fondo' y la SICAV). La SICAV es un organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) constituido al amparo de la Parte I de la Ley de 17 de diciembre de 2010 del Gran Ducado de Luxemburgo, acogido al régimen jurídico de las sociedades de inversión de capital variable e inscrito en el Registro Mercantil de Luxemburgo con el número B206810. La SICAV tiene su domicilio social en 5, allée Scheffer, L-2520 Luxemburgo. La comercialización del Subfondo ha sido autorizada por la Comisión de Vigilancia del Sector Financiero de Luxemburgo y Francia por la AMF. La SICAV tiene otros subfondos que se describen en el folleto. Todos los subfondos no se registran sistemáticamente en el país de jurisdicción para todos los inversores.

La descripción del Fondo se incluye en un Documento de datos fundamentales (KID) y el folleto. El KID del Fondo debe ponerse a disposición de los posibles suscriptores antes de la suscripción.

La información y los documentos están disponibles en [www.amundi.com](http://www.amundi.com), [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com). También están disponibles en la sede de Amundi Luxembourg S.A. (como sociedad gestora de Amundi Index Solutions), o en la sede de Amundi Asset Management (como sociedad gestora de los FCP franceses, Multi Units Luxembourg, Multi Units France), o en la sede de Amundi Ireland Limited (como sociedad gestora de Amundi ETF ICAV y Amundi ETF II ICAV). Los Fondos son instituciones de inversión colectiva extranjeras registradas en la CNMV. Los Fondos luxemburgueses fueron aprobados para su distribución pública en Luxemburgo por la Commission de Surveillance du Secteur Financier de Luxemburgo, los Fondos franceses fueron aprobados por la Autorité des Marchés Financiers francesa y los Fondos irlandeses fueron aprobados por el Central Bank of Ireland.

Para Amundi ETF:

- Los fondos Amundi ETF aprobados por la Comisión de Vigilancia del Sector Financiero están numerados: Amundi Index Solutions (1495). Amundi Index Solutions es una SICAV luxemburguesa, RCS B206810, situada en 5, allée Scheffer, L-2520 Luxemburgo.

- Los fondos ETF de Amundi aprobados por el Banco Central de Irlanda están numerados: Amundi ETF ICAV, Amundi ETF ICAV e Amundi ETF II ICAV es una ICAV irlandesa situada en 1 George's Quay Plaza, George's Quay, Dublín 2, D02 V002, Irlanda.v

- FCP franceses aprobados por las Autoridades de los Mercados Financieros

Cualquier inversión en los Fondos debe realizarse a través de un distribuidor español registrado. Amundi Iberia SGIIC, SAU, es el principal distribuidor de los Fondos en España, inscrito con el número 31 en el registro de SGIIC de la CNMV, con domicilio en Pº de la Castellana 1, Madrid 28046, España. La lista de todos los distribuidores españoles puede obtenerse de la CNMV en [www.cnmv.es](http://www.cnmv.es). Las participaciones/acciones sólo pueden adquirirse sobre la base del folleto más reciente, el documento de datos fundamentales y otra documentación vigente, que puede obtenerse en la CNMV.

La documentación legal de los Fondos también está disponible en la página web [www.amundi.com](http://www.amundi.com) o [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

En cuanto a los Fondos admitidos en un mercado regulado, la cotización está sujeta a un mecanismo de control de la volatilidad para asegurar que el precio del ETF no se desvíe significativamente de un precio de referencia fijado por las normas de cotización del mercado regulado pertinente, en particular mediante la aplicación de un mecanismo de interrupción de la negociación en caso de desviación significativa de este precio de referencia.

El Fondo no ofrece ninguna garantía respecto del capital. Es posible que los inversores no recuperen el importe íntegro de su inversión inicial, sobre todo si cae el índice de referencia. La inversión en OICVM puede conllevar riesgos. Se aconseja a los posibles inversores que lean el perfil de riesgo del Fondo, cuya descripción detallada se incluye en el folleto. Según las circunstancias personales de cada inversor, variará el importe que es razonable invertir en el Fondo. Para calcular dicho importe, los inversores deberán tener en cuenta su situación financiera, sus activos personales y los requisitos actuales y futuros, además de considerar su voluntad de aceptar riesgos o, por el contrario, su predilección por invertir con cautela. Asimismo, se recomienda encarecidamente a los inversores que diversifiquen suficientemente su inversión para evitar una exposición única a los riesgos del Fondo. Por lo tanto, los inversores deberán consultar con sus asesores habituales (legal, fiscal, financiero y/o contable) antes de comprar participaciones del Fondo.

Salvo especificación contraria, la fuente de los datos del presente documento es Amundi Asset Management.

**Política de transparencia y nota sobre mercado secundario**

La política reguladora en relación a la transparencia de la cartera y la información sobre los activos del fondo están disponibles en [amundiETF.com](http://amundiETF.com). Las acciones adquiridas en el mercado secundario normalmente no pueden ser vendidas directamente al fondo. Los inversores deben comprar y vender acciones en el mercado secundario con la asistencia de un intermediario (e.j. Sociedad o Agencia de Valores) lo que puede hacerles incurrir en gastos adicionales al hacerlo. Los inversores pueden pagar más del precio actual del valor liquidativo cuando compren acciones y recibir menos del precio actual del valor liquidativo cuando vendan.

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.