AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB - AU

REPORTING

Communication Publicitaire

29/02/2024

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **(C) 496,64 (USD)**
(D) 244,73 (USD)
Date de VL et d'actif géré : **29/02/2024**
Actif géré : **2 077,35 (millions USD)**
Code ISIN : **LU0442407853**
Code Bloomberg : **(C) CAINAC5 LX**
(D) AMIAAUD LX
Indice de référence :
100% MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB SELECT

Objectif d'investissement

Le Compartiment a pour objectif de répliquer la performance de l'Indice MSCI North America ESG Broad CTB Select et de minimiser l'écart de suivi entre la valeur liquidative du Compartiment et la performance de l'Indice. Le Compartiment vise à atteindre un niveau d'écart de suivi du Compartiment et de son indice qui ne dépassera normalement pas 1%.

Indicateur de risque *(Source : Fund Admin)*

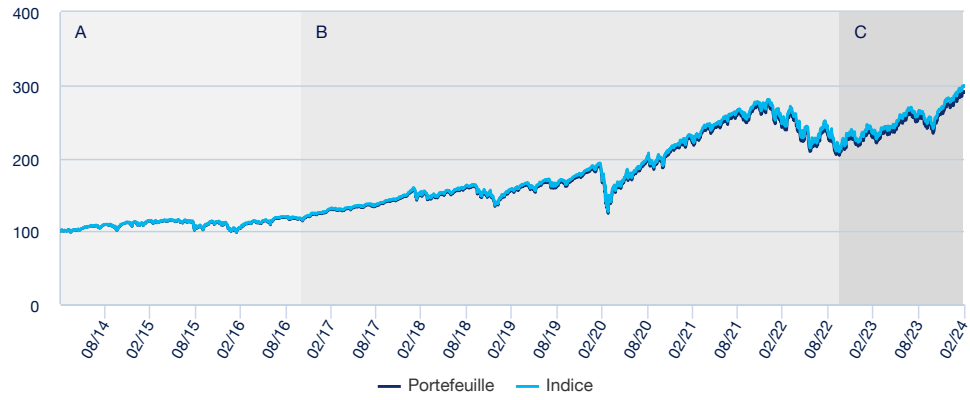
1	2	3	4	**5**	6	7

Risque le plus faible — Risque le plus élevé

⚠ L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 5 ans.
L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

Performances (Source : Fund Admin) - *Les performances passées ne préjugent pas des performances futures*

Evolution de la performance (VL) * (Source : Fund Admin)



A : Simulation effectuée sur la base des performances réalisées entre le 24 septembre 2008 et le 30 octobre 2016 par le Compartiment luxembourgeois « INDEX EQUITY NORTH AMERICA » de la SICAV « AMUNDI FUNDS » gérée par Amundi Asset Management et absorbée par AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA le 31 octobre 2016.
B : Performance du Compartiment depuis la date de son lancement
C : Depuis cette date, le compartiment déplacera son indice de référence de MSCI North America vers MSCI North America ESG Broad CTB Select Index

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le 29/12/2023	1 mois 31/01/2024	3 mois 30/11/2023	1 an 28/02/2023	3 ans 26/02/2021	5 ans 28/02/2019	Depuis le 21/12/2009
Portefeuille	6,17%	5,07%	11,41%	27,64%	32,12%	87,55%	397,45%
Indice	6,23%	5,08%	11,50%	28,03%	33,57%	90,24%	416,50%
Ecart	-0,07%	-0,01%	-0,08%	-0,39%	-1,45%	-2,69%	-19,05%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	24,99%	-19,72%	26,15%	19,76%	31,46%	-6,75%	20,64%	11,23%	-1,25%	11,73%
Indice	25,40%	-19,34%	26,44%	19,94%	31,81%	-6,53%	20,89%	11,57%	-0,90%	11,90%
Ecart	-0,41%	-0,38%	-0,28%	-0,19%	-0,35%	-0,22%	-0,25%	-0,34%	-0,35%	-0,16%

Caractéristiques principales (Source : Amundi)

Forme juridique : **SICAV**
Date de création de la classe : **29/06/2016**
Eligibilité : **-**
Eligible PEA : **Non**
Affectation des sommes distribuables :
(C) Capitalisation
(D) Distribution
Souscription minimum: 1ère / suivantes :
1 millième part(s)/action(s)
Limite de réception des ordres :
Ordres reçus chaque jour J avant 14:00
Frais d'entrée (maximum) : **4,50%**
Frais courants : **0,30% (prélevés)**
Frais de sortie (maximum) : **0,00%**
Durée minimum d'investissement recommandée : **5 ans**
Commission de surperformance : **Non**

Indicateur(s) glissant(s) (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Volatilité du portefeuille	13,67%	17,06%	20,17%	16,89%
Volatilité de l'indice	13,59%	16,99%	20,12%	16,86%

* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an.

AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB - AU

REPORTING

Communication Publicitaire
29/02/2024

ACTION ■

** Source : Amundi. Les performances ci-dessus couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile.* ***Les performances passées ne préjugent en rien des résultats actuels et futurs et ne sont pas garantes des rendements à venir****. Les gains ou pertes éventuels ne prennent pas en compte les frais, commissions et redevances éventuels supportés par l'investisseur lors de l'émission et du rachat des parts (ex : taxes, frais de courtage ou autres commissions prélevés par l'intermédiaire financier…). Si les performances sont calculées dans une devise autre que l'euro, les gains ou les pertes éventuellement générés peuvent de ce fait être impactées par les fluctuations des taux de change (à la hausse comme à la baisse). L'écart correspond à la différence de performance du portefeuille et de l'indice.*

Rencontrez l'équipe

Isabelle Lafargue

Responsable Gestion Indicielle & Multistratégies – Fonds Régionaux

Jerome Gueguen

Gérant de portefeuille principal

Vincent Masson

Gérant suppléant

Commentaire de gestion

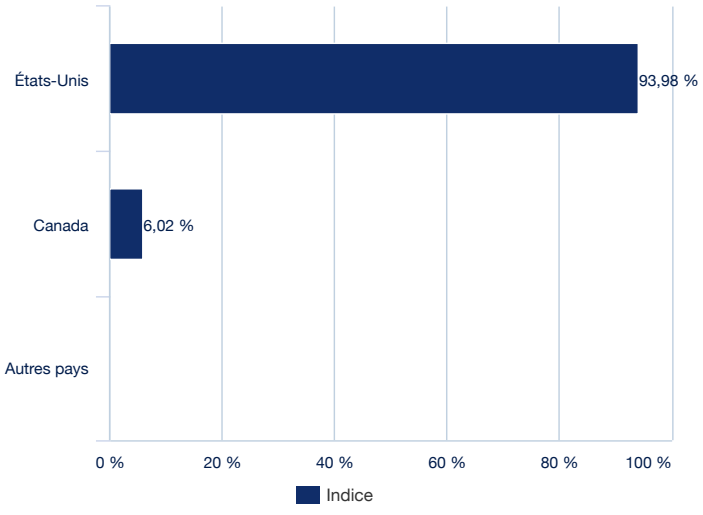
Les chiffres économiques parus en février ont signalé une activité toujours vigoureuse. Cela a été le cas, notamment, du rapport sur le marché du travail portant sur janvier, qui a fait état de 353 000 nouveaux emplois nets, un chiffre très supérieur aux attentes et à ceux des mois précédents. Le taux de chômage, pour sa part, est resté stable à un faible niveau (3,7%). Les indicateurs du climat des affaires ont également été meilleurs qu'attendu : tout en indiquant toujours une légère contraction de l'activité, l'ISM manufacturier est revenu sur un plus haut depuis octobre 2022, tandis que son homologue portant sur les services a fait état d'une forte expansion. Certaines données réelles, comme les ventes au détail de janvier, ont néanmoins déçu, incitant à la prudence quant aux perspectives des prochains mois. L'inflation, de son côté, n'a pas baissé autant qu'attendu : la hausse sur 12 mois de l'indice général des prix s'est réduite à 3,1% (contre 2,9% attendu, après 3,4% en décembre) celle de l'indice sous-jacent est restée inchangée à 3,9% (contre 3,7% attendu). De plus, l'indice d'inflation Core PCE, suivi par la Réserve fédérale, a enregistré en janvier sa plus forte hausse mensuelle depuis février 2023 (0,4%). La Réserve fédérale a continué de laisser entendre qu'il lui faudrait davantage de preuves de la poursuite de la désinflation avant qu'elle se décide à baisser ses taux directeurs.

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice MSCI North America ESG Broad CTB Select est un indice d'actions basé sur l'Indice MSCI North America représentatif des segments de moyenne à grande capitalisation des marchés américains et canadiens (l'« Indice parent »). L'Indice exclut les sociétés dont les produits ont un impact social ou environnemental négatif, et surpondère les sociétés ayant des scores ESG élevés. En outre, l'Indice vise à représenter la performance d'une stratégie qui repondère les titres en fonction des opportunités et des risques liés à la transition climatique afin de répondre aux exigences minimales de la dénomination de l'indice de référence « EU Climate Transition Benchmark » (EU CTB).

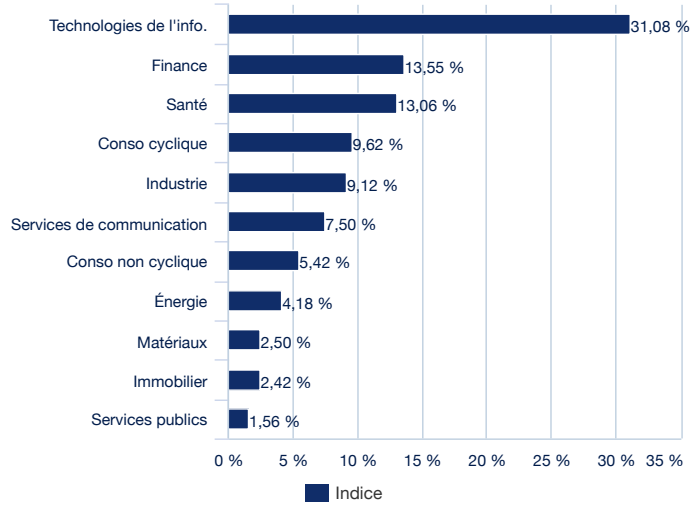
Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
MICROSOFT CORP	6,48%
APPLE INC	5,90%
NVIDIA CORP	4,31%
AMAZON.COM INC	3,37%
ALPHABET INC CL C	2,65%
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,99%
ELI LILLY & CO	1,54%
TESLA INC	1,24%
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,20%
BROADCOM INC	1,18%
Total	**29,86%**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Avertissement

Document simplifié et non contractuel, destiné à être remis exclusivement aux porteurs de parts. Les caractéristiques principales du fonds sont mentionnées dans sa documentation juridique, disponible sur le site de l'AMF ou sur simple demande au siège social de la société de gestion. La documentation juridique vous est remise avant toute souscription à un fonds. La durée du fonds est illimitée. Investir implique des risques : les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.