

# AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB - AU

INFORMES

Comunicación  
Publicitaria

29/02/2024

RENTA VARIABLE ■

## Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : (C) 496,64 ( USD )  
(D) 244,73 ( USD )

Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :  
29/02/2024

Activos : 2 077,35 ( millones USD )

Código ISIN : LU0442407853

Código Bloomberg : (C) CAINAC5 LX  
(D) AMIAAUD LX

Índice de referencia :  
100% MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB  
SELECT

## Objetivo de inversión

El objetivo de este Compartimento es reproducir la rentabilidad del índice MSCI North America ESG Broad CTB Select, y minimizar el error de seguimiento entre el valor liquidativo del Compartimento y la rentabilidad del Índice. El Compartimento trata de lograr un nivel de error de seguimiento entre el Compartimento y su índice que normalmente no supere el 1 %.

## 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 : Simulación basada en la rentabilidad desde el 24 de septiembre de 2008 hasta el 30 de octubre de 2016 del Compartimento luxemburgués "INDEX EQUITY NORTH AMERICA" de la SICAV "AMUNDI FUNDS" gestionada por Amundi Asset Management y absorbida por AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA el 31 de octubre de 2016.

B : Rendimiento del Subfondo desde la fecha de su lanzamiento

C : Since this date, the sub fund will move his benchmark from MSCI North America to MSCI North America ESG Broad CTB Select Index

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

	Desde el	Desde el	1 mes	3 meses	1 año	3 años	5 años	Desde el
	29/12/2023	31/01/2024	30/11/2023	28/02/2023	26/02/2021	28/02/2019	21/12/2009	
<b>Cartera</b>	6,17%	5,07%	11,41%	27,64%	32,12%	87,55%	397,45%	
<b>Índice</b>	6,23%	5,08%	11,50%	28,03%	33,57%	90,24%	416,50%	
<b>Diferencia</b>	-0,07%	-0,01%	-0,08%	-0,39%	-1,45%	-2,69%	-19,05%	

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

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

\* 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.

## Características principales (Fuente : Amundi)

Forma jurídica : IICVM

Fecha de creación : 29/06/2016

Elegibilidad : -

Eligible PEA : No

Asignación de los resultados :  
(C) Participaciones de Capitalización  
(D) Distribución

Mínimo de la primera suscripción :  
1 milésima parte de participación

Hora límite de recepción de órdenes :  
Órdenes recibidas cada día D antes 14:00

Gastos de entrada (máximo) : 4,50%

Gastos corrientes : 0,30% ( realizado )

Gastos de salida (máximo) : 0,00%

Periodo mínimo de inversión recomendado : 5 años

Comisión de rentabilidad : No

## Indicadores de Riesgo (Fuente : Fund Admin)

	1 año	3 años	5 años	10 Años
<b>Volatilidad de la cartera</b>	13,67%	17,06%	20,17%	16,89%
<b>Volatilidad del índice</b>	13,59%	16,99%	20,12%	16,86%

\* 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%.

RENDA VARIABLE ■

Conozca al Equipo



**Isabelle Lafargue**

Responsable Gestión Índice & Multiestrategias – Fondos Regionales



**Jerome Gueguen**

Lead Portfolio Manager



**Vincent Masson**

Gestor de cartera suplente

Comentario de gestión

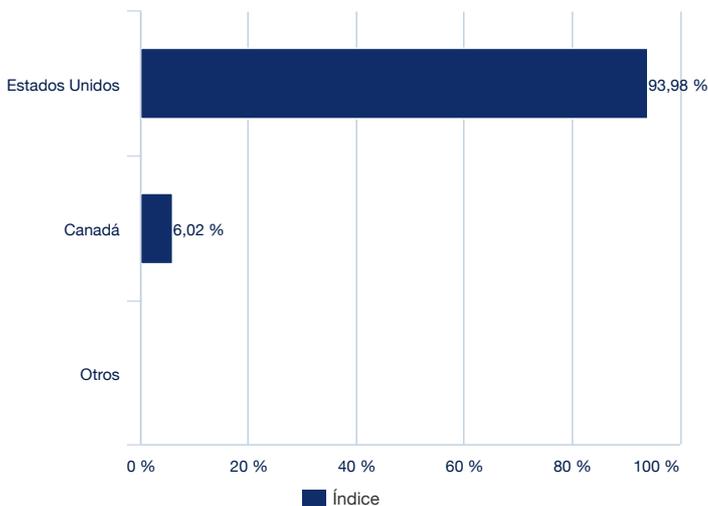
Los datos económicos publicados en febrero revelan que la actividad mantiene su vigor. Eso es lo que indica en particular el informe sobre el mercado laboral en enero, con la creación de 353 000 nuevos empleos netos, un dato muy superior a las expectativas y a los registros de los meses anteriores. La tasa de desempleo, por su parte, se mantiene estable en un nivel bajo (3,7%). Los indicadores del clima de los negocios también han superado las previsiones: aunque siguen indicando una ligera contracción de la actividad, el ISM manufacturero ha tocado su máximo desde octubre de 2022, mientras que su homólogo de los servicios ha experimentado una fuerte expansión. Sin embargo, algunos datos reales, como las ventas minoristas en enero, han decepcionado, lo que incita a la prudencia respecto a las perspectivas de los próximos meses. La inflación, por su parte, no ha bajado tanto como se esperaba: el incremento interanual del índice general de precios se ha reducido hasta el 3,1% (frente a una previsión del 2,9% y tras registrar un 3,4% en diciembre) y la del índice subyacente se ha mantenido invariado en el 3,9% (3,7% previsto). Asimismo, el índice de inflación Core PCE, referencia para la Fed, ha registrado en enero su mayor progresión mensual desde febrero de 2023 (+0,4%). La Reserva Federal sigue dando a entender que necesitará más pruebas de continuidad de la desinflación antes de decidir reducir sus tipos básicos.

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice MSCI North America ESG Broad CTB Select es un índice de renta variable basado en el índice MSCI North America, representativo de los valores de gran y mediana capitalización de los mercados estadounidense y canadiense (el «Índice padre»). El Índice excluye aquellas sociedades cuyos productos tienen impactos ambientales o sociales negativos, mientras que sobrepondera a las sociedades con una sólida puntuación ESG. 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 transición climática de la UE (EU CTB).

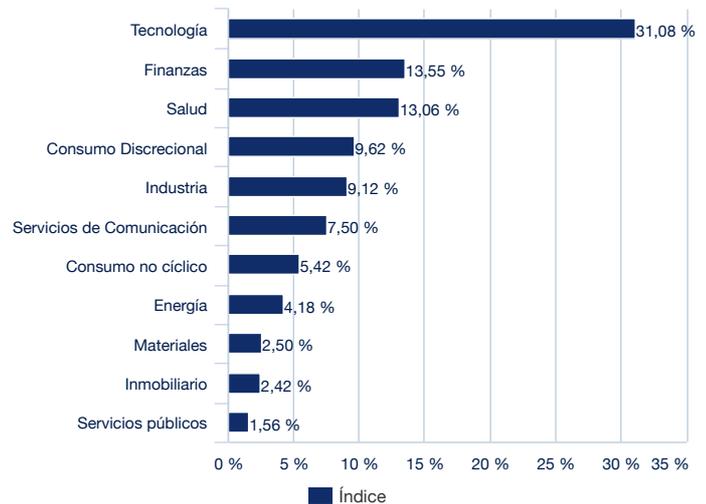
Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)
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%
<b>Total</b>	<b>29,86%</b>

Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



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.