

# AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB - AE

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/12/2022

ACTION ■

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : (C) 490,28 (EUR)  
(D) 482,19 (EUR)

Date de VL et d'actif géré : 30/12/2022

Actif géré : 2 018,79 (millions EUR)

Code ISIN : LU0389812347

Code Bloomberg : (C) CAINACC LX  
(D) CAINACD LX

Indice de référence :

100% MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD SELECT  
CTB

## 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%.

## Profil de risque et de rendement (SRRI) (Source : Fund Admin)



▲ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

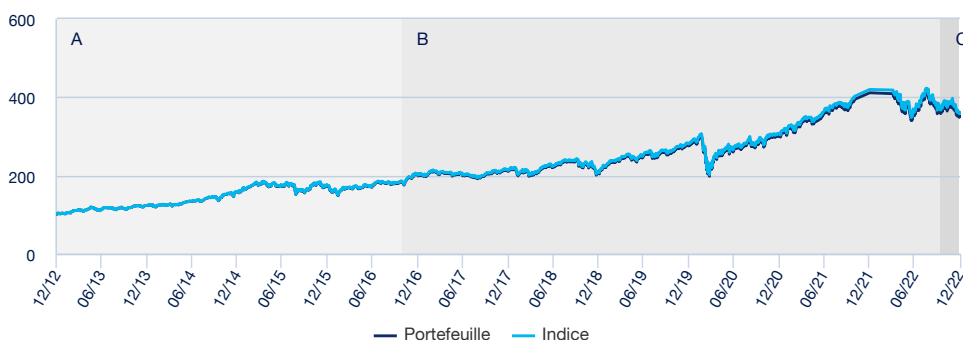
▲ A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

Le SRRI correspond au profil de risque et de rendement présent dans le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (DICI). La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Il n'est pas garanti et pourra évoluer dans le temps.

« Les valeurs liquidatives techniques peuvent être calculées et publiées tout jour civil (à l'exception des samedis et des dimanches) qui ne soit ni un jour ouvré ni un jour de transaction. Ces valeurs liquidatives techniques n'ont qu'une valeur indicative et ne serviront pas de base pour l'achat, la conversion, le rachat et/ou le transfert d'actions. »

## 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	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le
	31/12/2021	30/11/2022	30/09/2022	31/12/2021	31/12/2019	29/12/2017	24/09/2008
<b>Portefeuille</b>	-14,46%	-9,23%	-1,63%	-14,46%	27,56%	67,29%	391,69%
<b>Indice</b>	-14,05%	-9,22%	-1,55%	-14,05%	28,65%	69,56%	410,44%
<b>Ecart</b>	-0,40%	-0,01%	-0,08%	-0,40%	-1,09%	-2,28%	-18,75%

### Performances calendaires \* (Source : Fund Admin)

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013
<b>Portefeuille</b>	-14,46%	35,73%	9,86%	33,92%	-2,07%	5,97%	14,56%	10,00%	27,24%	23,77%
<b>Indice</b>	-14,05%	36,04%	10,04%	34,27%	-1,84%	6,19%	14,91%	10,39%	27,42%	23,97%
<b>Ecart</b>	-0,40%	-0,30%	-0,17%	-0,35%	-0,24%	-0,22%	-0,35%	-0,39%	-0,19%	-0,20%

\* 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 impactés 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.

## Caractéristiques principales (Source : Amundi)

Forme Juridique : SICAV  
Date de création du compartiment/OPC : 29/06/2016  
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) / 1 millième part(s)/action(s)  
Frais d'entrée (maximum) : 4,50%  
Frais courants : 0,30% (prélevés 30/09/2021)  
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
<b>Volatilité du portefeuille</b>	20,29%	21,01%	18,76%	16,72%
<b>Volatilité de l'indice</b>	20,23%	20,97%	18,72%	16,70%

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.

## ACTION ■

## Rencontrez l'équipe

**Lionel Brafman**

Responsable Gestion Indicielle &amp; Multistratégie

**Lionel Issom Nlep**

Gérant de portefeuille principal

**Jerome Gueguen**

Gérant suppléant

## Commentaire de gestion

Au cours du mois de décembre, les chiffres économiques ont montré une poursuite de la dégradation dans les économies avancées, quoi qu'à un rythme légèrement moindre qu'attendu.

Aux Etats-Unis, le taux de chômage, est resté stable à 3,7% tandis que le salaire horaire moyen a continué de progresser rapidement (+0,6% sur le seul mois de novembre), une situation qui a continué d'alimenter les craintes de boucle prix-salaires.

L'indicateur ISM manufacturier, toutefois, s'est installé en zone de légère contraction, sa composante portant sur les nouvelles commandes envoyant un message négatif pour l'activité des mois à venir.

A contrario, l'indicateur ISM non manufacturier a nettement surpris à la hausse, signalant un haut niveau d'activité dans les services.

L'inflation a poursuivi sa décrue, avec une hausse annuelle de 7,1% en novembre (6,0% pour l'inflation sous-jacente), après 7,7% en octobre et un pic à 9,1% en juin.

La Réserve fédérale a remonté la cible des taux Fed Funds de 50 points de base, portant sa borne haute à 4,5%, et communiqué sur le fait que sa tâche de lutte contre l'envolée de l'inflation n'était pas terminée.

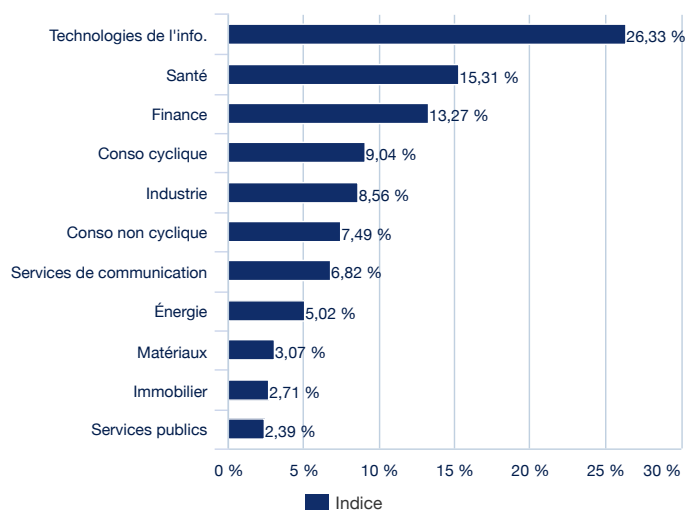
La performance des actions a reflété un environnement de taux d'intérêt et d'inflation plus élevés, les investisseurs se sont concentrés sur les actions décotées. Les secteurs de l'énergie, des matériaux, de l'industrie et de la finance ont mieux performé que les secteurs des technologies de l'information, des services de communication et de la consommation discrétionnaire.

## Données de l'indice (Source : Amundi)

## Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
APPLE INC	5,80%
MICROSOFT CORP	4,98%
AMAZON.COM INC	2,16%
ALPHABET INC CL C	1,40%
UNITEDHEALTH GRP INC	1,39%
COCA-COLA CO	1,39%
ALPHABET INC CL A	1,33%
JOHNSON & JOHNSON	1,33%
NVIDIA CORP	1,09%
JPMORGAN CHASE & CO	1,09%
<b>Total</b>	<b>21,94%</b>

## Secteurs de l'indice (source : Amundi)



## ACTION ■

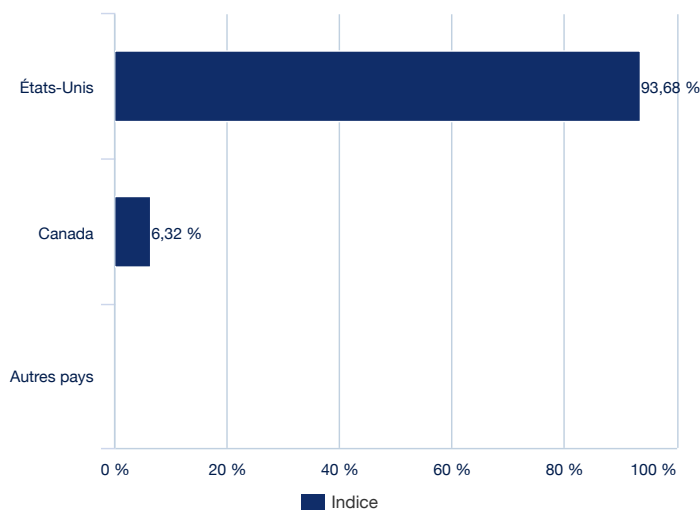
## Description de l'indice

AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB (LE « COMPARTIMENT ») N'EST EN AUCUNE FAÇON SPONSORISÉ, AVALISÉ, VENDU OU PROMU PAR MSCI INC. (« MSCI »), NI PAR L'UNE DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, L'UN DE SES FOURNISSEURS D'INFORMATIONS OU AUCUN TIERS CONCERNÉ PAR LA COMPOSITION OU LA CRÉATION D'UN INDICE MSCI (COLLECTIVEMENT, LES « PARTIES MSCI »). LES INDICES MSCI SONT LA PROPRIÉTÉ EXCLUSIVE DE MSCI ET SONT DES MARQUES DE SERVICE DE MSCI OU DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES. LES INDICES MSCI ONT FAIT L'OBJET D'UNE LICENCE ACCORDÉE, POUR CERTAINS BESOINS, À AMUNDI. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE FAIT DE DÉCLARATION, NI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ÉMETTEUR OU AUX PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, OU À TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, CONCERNANT LA PERTINENCE D'INVESTIR DANS LES COMPARTIMENTS EN GÉNÉRAL OU DANS CE COMPARTIMENT EN PARTICULIER, OU LA CAPACITÉ DE TOUT INDICE MSCI À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DU MARCHÉ BOURSIER CORRESPONDANT. MSCI OU SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES SONT LES CONCÉDANTS DE LA LICENCE DE CERTAINES MARQUES DÉPOSÉES, MARQUES DE SERVICE ET NOMS COMMERCIAUX, AINSI QUE DES INDICES MSCI DÉTERMINÉS, COMPOSÉS ET CALCULÉS PAR MSCI, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI, DE CE COMPARTIMENT, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ.

AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST TENUE DE PRENDRE EN COMPTE LES BESOINS D'AMUNDI, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ DANS LE CADRE DE LA DÉFINITION, DE LA COMPOSITION OU DU CALCUL DES INDICES MSCI. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST RESPONSABLE DE LA DÉTERMINATION DE LA DATE DE LANCEMENT, DU PRIX OU DE LA QUANTITÉ DES ACTIONS DU COMPARTIMENT, NI DE LA DÉTERMINATION OU DU CALCUL DE LA FORMULE/DES CRITÈRES SELON LESQUELS, LE COMPARTIMENT EST REMBOURSABLE, AUTANT D'OPÉRATIONS AUXQUELLES AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A PRIS PART. PAR AILLEURS, AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A D'OBLIGATION OU DE RESPONSABILITÉ À L'ÉGARD DE L'ÉMETTEUR, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ RELATIVEMENT À L'ADMINISTRATION, À LA COMMERCIALISATION ET À L'OFFRE DE CE COMPARTIMENT.

BIEN QUE MSCI OBTIENNE DES INFORMATIONS À INCLURE OU À UTILISER DANS LE CALCUL DES INDICES MSCI PROVENANT DE SOURCES QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, LA PRÉCISION ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI INDEX OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, LES RÉSULTATS DEVANT ÊTRE OBTENUS PAR L'ÉMETTEUR DU COMPARTIMENT, LES PORTEURS DE PARTS DE CE DERNIER OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, ET PROVENANT DE L'UTILISATION DE TOUT INDICE MSCI INDEX OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE PEUT ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION RELATIVES AUX INDICES MSCI INDEX OU À TOUTE DONNÉE Y FIGURANT. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE DONNE DE GARANTIE EXPRESSE OU IMPLICITE DE QUELQUE SORTE QUE CE SOIT, ET LES PARTIES MSCI N'EXPRIMENT AUCUNE GARANTIE DE QUALITÉ MARCHANDE ET D'ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER EN CE QUI CONCERNE LES INDICES MSCI INDEX ET TOUTE DONNÉE Y FIGURANT. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE POURRA ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTS DOMMAGES DIRECTS, INDIRECTS, SPÉCIAUX, PUNITIFS, CONSÉCUTIFS OU AUTRES (Y COMPRIS UNE QUELCONQUE Perte DE BÉNÉFICES), QUAND BIEN MÊME ELLE AURAIT ÉTÉ AVISÉE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

## Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



ACTION ■

**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.