AMUNDI S&P 500 ESG INDEX AU

REPORTING

Communication Publicitaire

29/02/2024

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **(C) 312,13 (USD)**
(D) 195,39 (USD)
Date de VL et d'actif géré : **29/02/2024**
Actif géré : **1 980,07 (millions USD)**
Code ISIN : **LU0996178884**
Code Bloomberg : **(C) AIUSAUC LX**
(D) AIUSAUD LX
Indice de référence : **100% S&P 500 ESG+ INDEX**

Objectif d'investissement

Amundi S&P 500 ESG a pour objectif de répliquer au plus près la performance de l'indice S&P 500 ESG+, à la hausse comme à la baisse. Ce compartiment offre une exposition à des titres répondant à des critères de durabilité, tout en conservant une pondération globale des groupes industriels similaire à celle du S&P 500, à l'exclusion des émetteurs impliqués dans le tabac, le charbon thermique et les armes controversées.

Indicateur de risque *(Source : Fund Admin)*

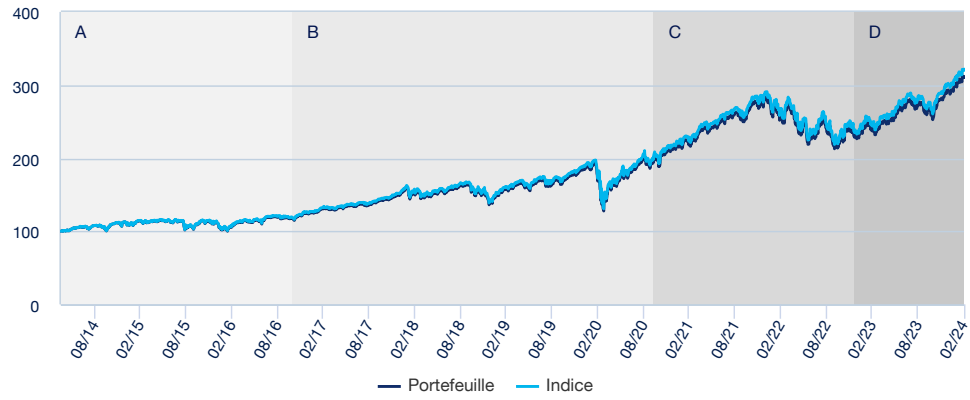
1	2	3	4	**5**	6	7

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 10 mai 2005 et le 30 octobre 2016 par le Compartiment luxembourgeois « INDEX EQUITY USA » de la SICAV « AMUNDI FUNDS » gérée par Amundi Asset Management et absorbée par AMUNDI INDEX S&P 500 le 31 octobre 2016.
B : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment a été l'indice S&P 500.
C : Depuis le début de cette période, l'indicateur de référence du compartiment est S&P 500 ESG
D : Since the beginning of this period, the reference indicator of the Sub-Fund is S&P 500 ESG+ 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 17/04/2014
Portefeuille	6,63%	4,97%	11,08%	31,03%	43,19%	98,37%	211,91%
Indice	6,69%	4,99%	11,16%	31,39%	44,29%	100,86%	221,81%
Ecart	-0,06%	-0,02%	-0,08%	-0,37%	-1,10%	-2,49%	-9,90%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	27,33%	-18,38%	31,72%	16,05%	31,50%	-6,05%	20,73%	10,56%	0,34%	-
Indice	27,70%	-18,16%	31,95%	16,31%	31,82%	-5,75%	21,10%	11,23%	0,75%	-
Ecart	-0,38%	-0,23%	-0,23%	-0,26%	-0,32%	-0,29%	-0,37%	-0,67%	-0,41%	-

** 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.*

Notation Morningstar ©

Notation Morningstar "Overall" © : **4 étoiles**
Catégorie Morningstar © :
ACTIONS AMÉRICAINES À GRANDE CAPITALISATION – MIXTE
Date de notation : **31/01/2024**
Nombre de fonds de la catégorie : **1695**

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
Volatilité du portefeuille	13,01%	16,87%	19,96%
Volatilité de l'indice	12,99%	16,81%	19,89%

* 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 S&P 500 ESG INDEX AU

REPORTING

Communication Publicitaire
29/02/2024

ACTION ■

Rencontrez l'équipe



Isabelle Lafargue

Responsable Gestion Indicielle & Multistratégies – Fonds Régionaux



Pierre Navarre

Gérant de Portefeuille - Index & Multistrategies



Salah Benaissa

Gérant suppléant

Commentaire de gestion

Les chiffres économiques publiés en février sont restés, dans l'ensemble, bons aux Etats-Unis et médiocres en Europe. Dans les économies émergentes, une légère amélioration a été observée. Aux Etats-Unis comme en Europe, la désinflation a continué, mais de façon moins rapide que fin 2023. Les grandes banques centrales occidentales ont réitéré qu'elles baisseraient probablement leurs taux au cours des prochains mois, mais peut-être un peu plus tardivement qu'attendu par les marchés. Les actions sont restées orientées à la hausse. Les rendements obligataires ont poursuivi leur rebond entamé en janvier.

Aux Etats-Unis, 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). 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.

Les investisseurs ont acheté le scénario du « soft landing », entrainant à la hausse les marchés d'actions ce mois-ci. Par ricochet, les actions mondiales en ont bénéficié, le MSCI ACWI gagnant +4,5%. Les Etats-Unis progressent de 5,2% et surperforment l'Europe (+2,2%). Les marchés de la zone euro (+3,2%) font mieux, avec comme principaux contributeurs, l'Italie (+6,2%) et les Pays-Bas (+5,4%). Hors zone euro, le marché suédois (5%) a su tirer son épingle du jeu en février. Le MSCI pays émergents progresse (+5%) entrainé par la surperformance du marché chinois (+8,6%).

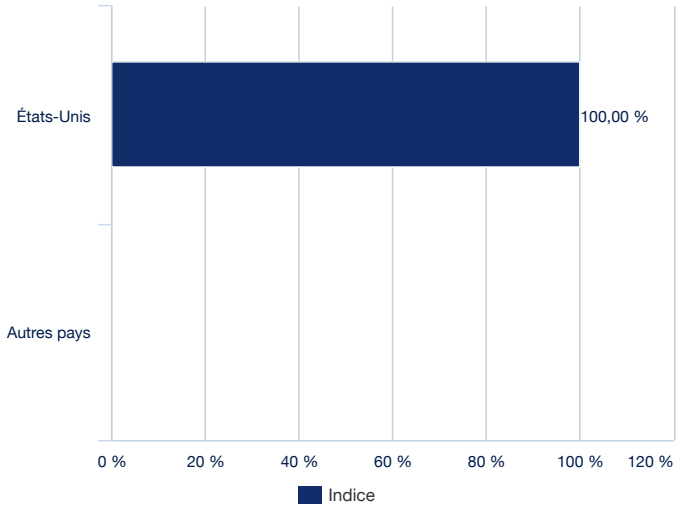
Dans ce contexte, l'indice affiche une performance de 5.39% sur le mois.

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'indice S&P 500 ESG+ (l'« Indice ») est un indice élargi pondéré par la capitalisation boursière qui mesure la performance des titres qui répondent aux critères de durabilité, tout en conservant une pondération globale au niveau sectoriel similaire à celle de l'indice S&P 500 (l'« Indice cadre »). L'indice S&P 500 est un indice d'actions représentatif des titres de premier plan négociés aux États-Unis.

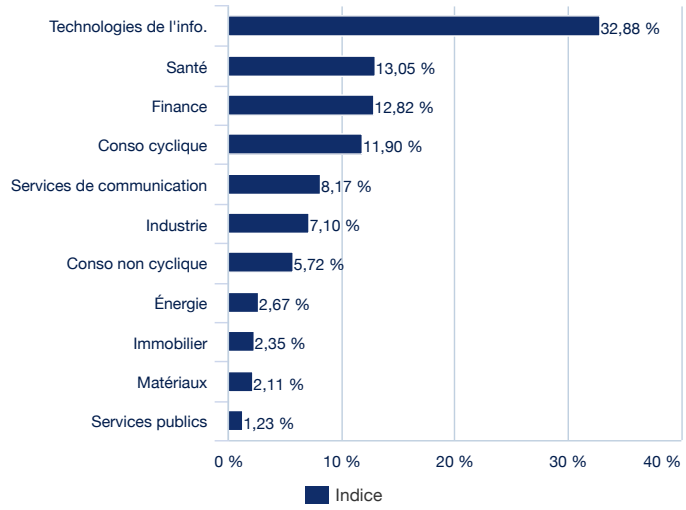
Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
MICROSOFT CORP	9,65%
APPLE INC	8,44%
NVIDIA CORP	6,11%
AMAZON.COM INC	5,01%
ALPHABET INC CL A	2,57%
ALPHABET INC CL C	2,18%
ELI LILLY & CO	1,92%
TESLA INC	1,78%
JPMORGAN CHASE & CO	1,70%
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,47%
Total	**40,83%**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Amundi Asset Management, Société par Actions Simplifiée au capital de 1 143 615 555 €
Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF N° GP 04000036
Siège social : 91-93, boulevard Pasteur – 75015 Paris – France 437 574 452 RCS Paris

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.