AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT - IHU

REPORTING

Communication Publicitaire

28/02/2022

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **1 698,30 (USD)**
Date de VL et d'actif géré : **28/02/2022**
Actif géré : **2 590,78 (millions USD)**
Code ISIN : **LU1322783934**
Code Bloomberg : **AIEEIHC LX**
Indice de référence :
100% MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% ISSUER CAPPED 100% HEDGED TO USD

Objectif d'investissement (Source : Amundi)

AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT a pour objectif de répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI EMU ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index (Total return index) à la hausse comme à la baisse. Ce compartiment permet une exposition aux actions d'entreprises de grandes et moyennes capitalisations boursières de 10 pays développés de la zone Euro et dotées des meilleures notations en termes environnementaux, sociaux et de gouvernance. Les entreprises impliquées dans l'énergie nucléaire, le tabac, le charbon, l'alcool, le jeu, les armes militaires, les armes à feu civiles sont exclues de l'indice et chaque poids constitutif est plafonné à 5%.

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

1	2	3	4	5	**6**	7

A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

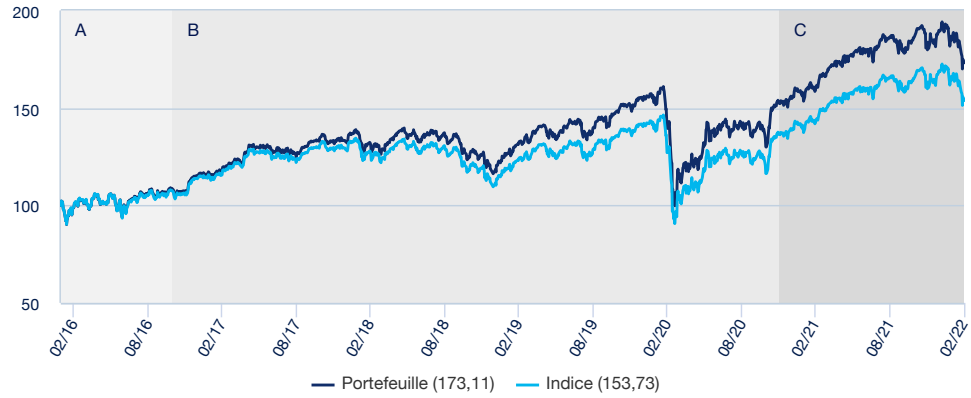
A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

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 calculée 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 (base 100) * (Source : Fund Admin)



A : Simulation effectuée sur la base des performances réalisées entre le 23 septembre 2008 et le 30 octobre 2016 par le Compartiment luxembourgeois « INDEX EQUITY EURO » de la SICAV « AMUNDI FUNDS » gérée par Amundi Asset Management et absorbée par AMUNDI INDEX MSCI EMU le 31 octobre 2016.
B : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment a été l'indice MSCI EMU.
C : Depuis le début de cette période, l'indicateur de référence du compartiment est MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le 31/12/2021	1 mois 31/01/2022	3 mois 30/11/2021	1 an 26/02/2021	3 ans 28/02/2019	5 ans 28/02/2017	Depuis le 28/01/2016
Portefeuille	-8,62%	-6,94%	-3,71%	9,24%	31,23%	47,52%	73,11%
Indice	-8,86%	-7,02%	-3,81%	8,36%	24,35%	32,75%	53,73%
Ecart	0,24%	0,08%	0,10%	0,89%	6,88%	14,77%	19,38%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017
Portefeuille	22,39%	0,64%	32,30%	-12,50%	15,53%
Indice	21,78%	-1,35%	28,17%	-14,98%	13,39%
Ecart	0,61%	1,99%	4,13%	2,47%	2,14%

** 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.*

Indicateurs de risque (Source : Amundi)

	1 an	3 ans	5 ans
Volatilité du portefeuille	11,49%	22,12%	18,91%
Volatilité de l'indice	11,25%	22,03%	18,84%
Tracking Error ex-post	0,85%	0,78%	0,62%
Ratio de Sharpe	0,91	0,41	0,39
Ratio d'information	0,86	2,46	3,62

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.
Le Ratio de sharpe est un indicateur statistique qui mesure la performance du portefeuille par rapport à un placement sans risque

AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT - IHU

REPORTING

Communication Publicitaire
28/02/2022

ACTION ■

Rencontrez l'équipe



Lionel Brafman

Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie



Vincent Masson

Gérant de portefeuille senior - Index & Multistrategies



Jerome Gueguen

Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description

L'indice MSCI EMU ESG Leaders Select 5% Issuer Capped est un indice d'actions basé sur l'indice MSCI EMU (l'« Indice cadre »), représentatif des titres de moyenne à grande capitalisation de 10 pays développés (en septembre 2020) de l'Union économique et monétaire européenne et émis par des sociétés assorties de notations exceptionnelles en matière environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) dans chaque secteur de l'Indice cadre.

Caractéristiques (Source : Amundi)

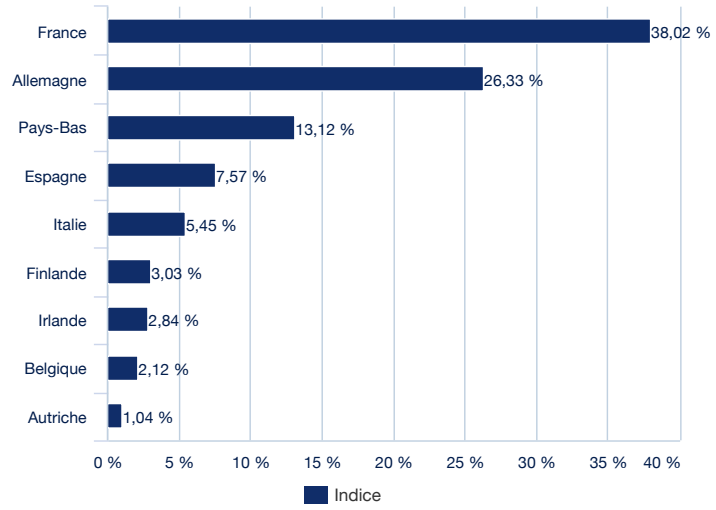
Classe d'actif : **Action**
Exposition : **Zone Euro**
Code Bloomberg de l'indice : **MXEMUEL5**

Nombre de valeurs : **104**

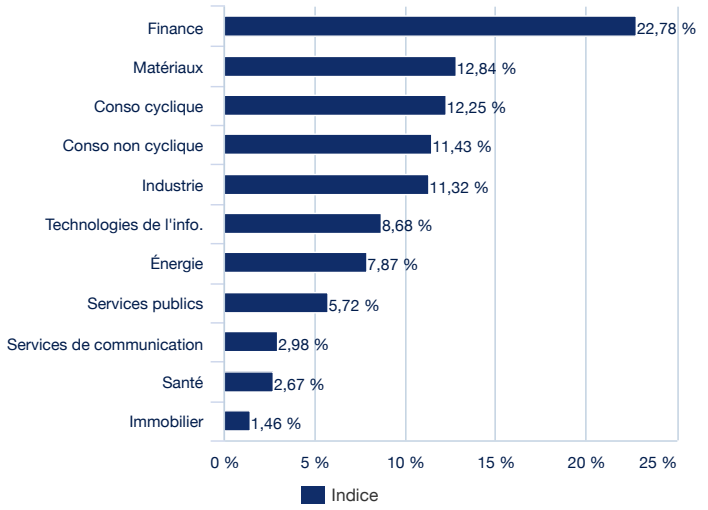
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
TOTALENERGIES SE	5,63%
SAP SE	4,47%
ASML HOLDING NV	4,21%
L OREAL	4,13%
ALLIANZ SE-REG	3,98%
SCHNEIDER ELECT SE	3,52%
AIR LIQUIDE SA	3,26%
BNP PARIBAS	2,97%
IBERDROLA SA	2,69%
BASF SE XETRA	2,58%
Total	**37,43%**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Commentaire de gestion

Baisse des marchés actions européens en février (MSCI EMU -5.23%). Les principaux indices boursiers ont chuté (Dax -6.5%, Cac -4.9%) pénalisés par la transformation en guerre du conflit géopolitique entre la Russie et l'Ukraine. En dépit des discussions engagées avec les Etats-Unis et l'UE, la Russie a décidé de concrétiser ses menaces en envahissant l'Ukraine. A cet effet, les Etats-Unis et l'UE ont annoncé une série de sanctions contre la Russie comme notamment le gel des avoirs financiers russes et l'exclusion de certaines banques du pays du système de transaction international Swift. A noter une performance quasi stable du FTSE 100 (-0.1%) qui profite de son exposition aux secteurs Métaux & Mines et Défense.
Meilleure performance des secteurs indexés aux matières premières qui ont considérablement progressé tout au long du mois à cause des craintes autour de leur approvisionnement. Le Baril de Brent a dépassé les 100$. Le prix de l'acier a progressé de près de +14.9%.
Le secteur des Ressources de base (+8.5%) affiche la meilleure performance sectorielle en dépit de la forte contre-performance de Polymetal International (-66.9%) à cause de sa très forte exposition à la Russie. Plus largement l'ensemble des valeurs avec une exposition russe ont sous-performé.
Les secteurs des Utilities (+1.9%) et Energy (+0.8%) profitent de la forte hausse des prix de l'énergie et du rallye des valeurs renouvelables notamment suite aux propos de la commission européenne (U. von der Leyen) qui a déclaré que l'UE devait diversifier ses sources d'énergie en investissant massivement dans les énergies renouvelables.
Forte sous-performance des secteurs financiers : Assurances (-7.8%) et Banques (-9.3%) pénalisés par les craintes macro-économiques et la baisse des taux US/Allemands, qui ont plus que contrebalancé les résultats de bonne qualité, et du secteur Retail (-10.3%) en dépit de résultats souvent meilleurs qu'anticipé.
Au niveau de l'indice, le mois de février a été caractérisé par la revue trimestrielle de l'indice qui s'est déroulée sur les cours de clôture du 28 février. Aucun titre n'en est sorti ou entré.

Amundi Asset Management, Société par Actions Simplifiée au capital de 1 086 262 605 €
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
Ce document est destiné à être remis exclusivement aux investisseurs « professionnels ».

AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT - IHU

REPORTING

Communication Publicitaire
28/02/2022

ACTION ■

Caractéristiques principales (Source : Amundi)

Forme Juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Dépositaire	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	29/06/2016
Devise de référence de la classe	USD
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1322783934
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,15% (prélevés) - 19/01/2022
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	Eligible au PEA
Clôture fiscale	Septembre

Avertissement

Ce document est fourni à titre d'information seulement et il ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation ou une offre, un conseil ou une invitation d'achat ou de vente des parts ou actions des FCP, FCPE, SICAV, compartiment de SICAV, SPPICAV présentés dans ce document (« les OPC ») et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. Ce document ne constitue pas la base d'un contrat ou d'un engagement de quelque nature que ce soit. Toutes les informations contenues dans ce document peuvent être modifiées sans préavis. La société de gestion n'accepte aucune responsabilité, directe ou indirecte, qui pourrait résulter de l'utilisation de toutes informations contenues dans ce document. La société de gestion ne peut en aucun cas être tenue responsable pour toute décision prise sur la base de ces informations. Les informations contenues dans ce document vous sont communiquées sur une base confidentielle et ne doivent être ni copiées, ni reproduites, ni modifiées, ni traduites, ni distribuées sans l'accord écrit préalable de la société de gestion, à aucune personne tierce ou dans aucun pays où cette distribution ou cette utilisation serait contraire aux dispositions légales et réglementaires ou imposerait à la société de gestion ou à ses fonds de se conformer aux obligations d'enregistrement auprès des autorités de tutelle de ces pays. Tous les OPC ne sont pas systématiquement enregistrés dans le pays de juridiction de tous les investisseurs. Investir implique des risques : les performances passées des OPC présentées dans ce document ainsi que les simulations réalisées sur la base de ces dernières, ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne préjugent pas des performances futures de ces derniers. 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. Les prospectus complets des OPC de droit français visés par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sont disponibles gratuitement sur simple demande au siège social de la société de gestion. Concernant les mandats de gestion, ce document fait partie du relevé des activités de gestion de votre portefeuille et doit être lu conjointement avec tout autre relevé périodique ou avis de confirmation relatif aux opérations de votre portefeuille, fourni par votre teneur de compte. La source des données du présent document est la société de gestion sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée sous la mention SYNTHESE DE GESTION en tête du document sauf mention contraire.

Ce document est destiné à être remis exclusivement aux investisseurs institutionnels, professionnels, qualifiés ou sophistiqués et aux distributeurs. Ne doit pas être remis au grand public, à la clientèle privée et aux particuliers au sens de toute juridiction, ni aux "US Persons". Les investisseurs visés sont, en ce qui concerne l'Union Européenne, les investisseurs "Professionnels" au sens de la Directive 2004/39/CE du 21 avril 2004 "MIF" ou, le cas échéant au sens de chaque réglementation locale et, dans la mesure où l'offre en Suisse est concernée, les "investisseurs qualifiés" au sens des dispositions de la Loi fédérale sur les placements collectifs (LPCC), de l'Ordonnance sur les placements collectifs du 22 Novembre 2006 (OPCC) et de la Circulaire FINMA 08/8 au sens de la législation sur les placements collectifs du 20 Novembre 2008. Ce document ne doit en aucun cas être remis dans l'Union Européenne à des investisseurs non "Professionnels" au sens de la MIF ou au sens de chaque réglementation locale, ou en Suisse à des investisseurs qui ne répondent pas à la définition d'"investisseurs qualifiés" au sens de la législation et de la réglementation applicable.