AMUNDI INDEX MSCI JAPAN - IHU

REPORTING

Communication Publicitaire

28/02/2022

ACTION

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **1 606,70 (USD)**
Date de VL et d'actif géré : **28/02/2022**
Actif géré : **873,84 (millions USD)**
Code ISIN : **LU1322783850**
Code Bloomberg : **AIEJIHU LX**
Indice de référence : **100% MSCI JAPAN**

Objectif d'investissement (Source : Amundi)

Suivre la performance de l'indice MSCI Japan (l'« indice ») et réduire le tracking error entre la valeur liquidative du compartiment et la performance de l'indice. Le MSCI Japan est un indice d'actions représentatif des moyennes et grandes capitalisations du marché japonais. Il s'agit d'un indice à performance nette totale : les dividendes nets d'impôts payés par les composants de l'indice sont inclus dans la performance de l'indice.

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

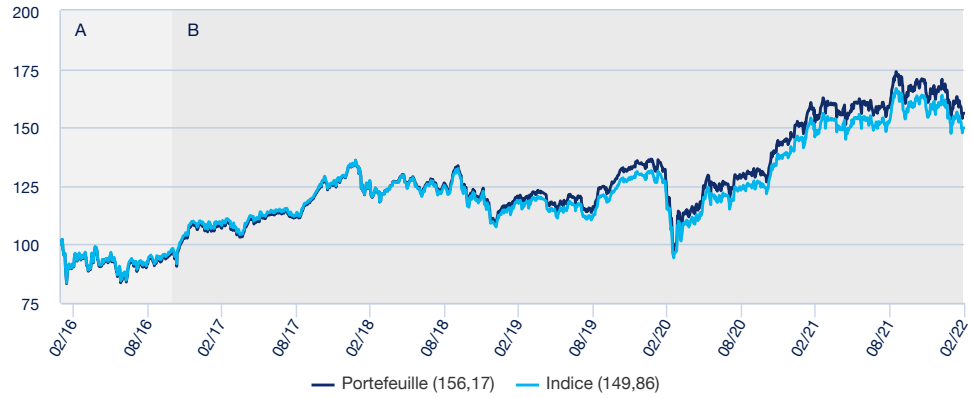
A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

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 (i) entre le 10 mai 2005 et le 14 avril 2014 par le Fonds français « AMUNDI INDEX JAPON » absorbé par le Compartiment luxembourgeois « INDEX EQUITY JAPAN » de la SICAV « AMUNDI FUNDS » le 15 avril 2014 et (ii) entre le 15 avril 2014 et le 30 octobre 2016 par le Compartiment « INDEX EQUITY JAPAN » de la SICAV « AMUNDI FUNDS » gérée par Amundi Japan et absorbée par le Compartiment « AMUNDI INDEX MSCI JAPAN » de la SICAV « AMUNDI INDEX SOLUTIONS » le 31 octobre 2016.
B : Performance du Compartiment depuis la date de son lancement

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 29/01/2016
Portefeuille	-6,12%	-1,16%	-2,92%	2,68%	30,57%	46,06%	56,17%
Indice	-6,12%	-1,16%	-2,98%	2,70%	27,53%	38,60%	49,86%
Ecart	0,00%	0,00%	0,06%	-0,02%	3,05%	7,46%	6,31%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017
Portefeuille	13,35%	9,42%	21,17%	-13,82%	20,81%
Indice	13,44%	8,76%	18,48%	-15,15%	19,75%
Ecart	-0,09%	0,66%	2,69%	1,33%	1,06%

** 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	14,21%	20,01%	18,01%
Volatilité de l'indice	14,13%	19,90%	17,94%
Tracking Error ex-post	0,24%	0,31%	0,29%
Ratio de Sharpe	0,16	0,41	0,36
Ratio d'information	-0,08	2,73	3,83

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 INDEX MSCI JAPAN - IHU

REPORTING
Communication Publicitaire
28/02/2022

ACTION ■

Rencontrez l'équipe



Nobuaki Kato
Responsable Gestion Indicielle & Multistratégies Actions (Tokyo)



Satoru KOBAYASHI
Gérant suppléant



Keisuke NAKAYAMA
Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description

L'Indice MSCI Japan est un indice d'actions représentatif des segments de moyenne à grande capitalisation du marché japonais.

Caractéristiques (Source : Amundi)

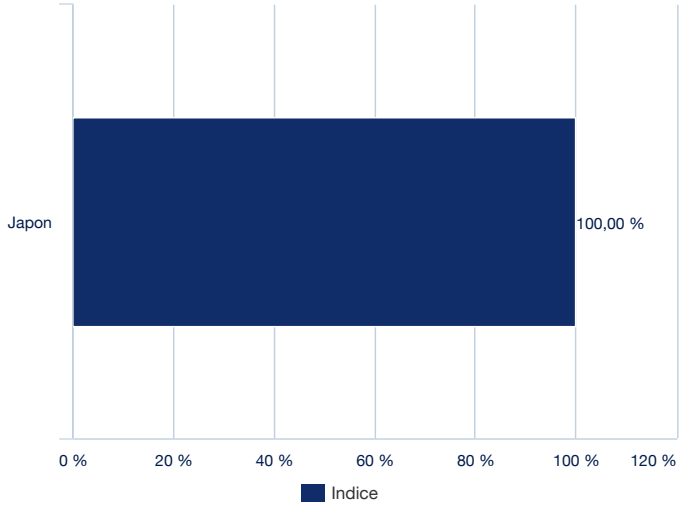
Classe d'actif : **Action**
Exposition : **Japon**
Code Bloomberg de l'indice : **NDDLJN**

Nombre de valeurs : **259**

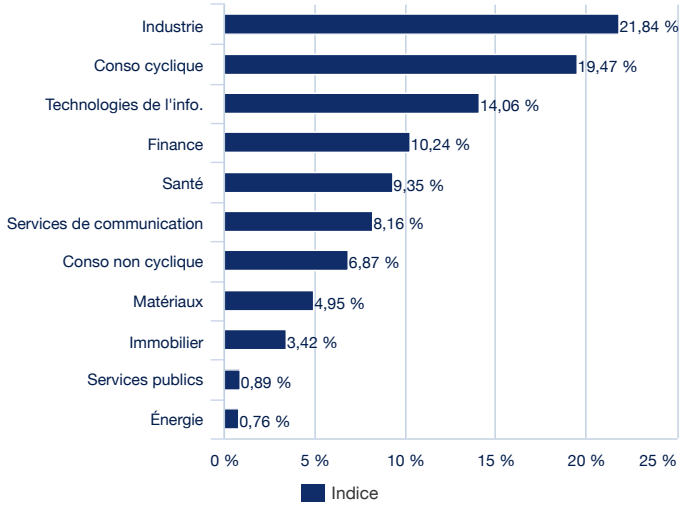
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
TOYOTA MOTOR	5,32%
SONY CORP	3,55%
KEYENCE CORP	2,53%
MITSUBISHI UFJ FIN	2,06%
TOKYO ELECTRON LTD	2,02%
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	1,59%
NINTENDO CO LTD	1,52%
SHIN-ETSU CHEMICAL	1,48%
SOFTBANK GROUP CORP	1,46%
KDDI CORPORATION	1,42%
Total	**22,96%**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Commentaire de gestion

Au Japon, les commandes de machines de base ont augmenté de 3,6% en décembre en glissement mensuel sur une base désaisonnalisée. Le rythme de croissance s'est légèrement accéléré par rapport aux données de novembre, où il avait augmenté de 3,4%. Sur une base annuelle, elles ont augmenté de 5,1% en décembre. Compte tenu de ce résultat en décembre, les commandes de machines ont augmenté de 6,8 % en moyenne en 2021, ce qui représente une reprise remarquable par rapport aux 8,4 % de baisses enregistrées en 2020. D'autre part, les exportations de marchandises en janvier n'ont augmenté que de 9,6 % sur une base annuelle, tandis que les importations de marchandises ont augmenté de 39,6 % au cours de la même période. Cela a conduit la balance commerciale des marchandises à se détériorer et à enregistrer un déficit de 2,2 billions de yens en janvier. En ce qui concerne les exportations, l'effet quantité a été négatif, ce qui a entraîné une stagnation de la croissance. Parallèlement, l'effet prix a eu un impact significatif sur l'augmentation des importations.
En février, le fonds a principalement reçu des dividendes de : SEVEN I HOLDINGS, SEKISUI HOUSE LTD JPY50, JAPAN RETAIL INVESTMENT, FAST RETAILING CO JPY50, NOMURA REIT MASTER, DAIWAHOUSE RESIDENTIAL INV, GLP J-REIT, AEON CO LTD, ORIX JREIT INC et YASKAWA ELECTRIC CORP.
D'un point de vue sectoriel, les actions des secteurs de l'énergie, des services publics et de la finance ont surperformé l'indice de référence, tandis que les actions des secteurs des technologies de l'information, de l'industrie et de la santé ont sous-performé au cours du mois.
En février, le yen s'est déprécié de -0,02% par rapport à l'USD à 115,18, tandis qu'il s'est apprécié de 0,67% contre le CHF à 125,54, de 0,93% contre la GBP à 154,54, de 1,23% contre l'EUR à 129,36 et de 2,59% contre la CZK à 5,14.

Amundi
ASSET MANAGEMENT

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 INDEX MSCI JAPAN - 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	LU1322783850
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,15% (prélevés) - 19/01/2022
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
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.