

AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA - AE

REPORTING

Communication Publicitaire

31/08/2024

ACTIONS ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **147,80 (EUR)**
 Date de VL et d'actif géré : **30/08/2024**
 Actif géré : **38,31 (millions EUR)**
 Code ISIN : **LU1437019307**
 Code Bloomberg : **AIEGMAE LX**
 Indice de référence :
100% SCIENTIFIC BETA DEVELOPED MULTI-BETA MULTI-STRATEGY ERC

Objectif d'investissement

L'objectif est de répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice de stratégie Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy ERC (« l'Indice de stratégie ») quelle que soit son évolution, positive ou négative. Le Compartiment vise à atteindre un niveau d'écart de suivi du Compartiment et de son indice qui ne dépassera pas normalement 1 %.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



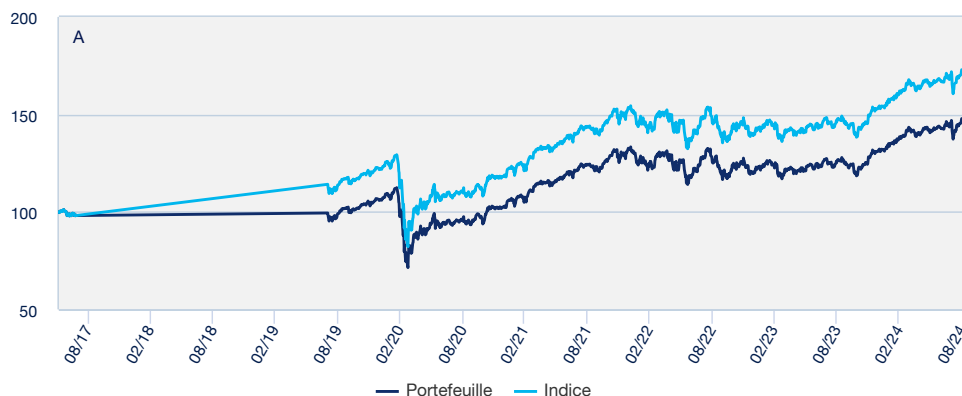
Risque le plus faible

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 : Performance du Compartiment depuis la date de son lancement

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le 29/12/2023	1 mois 31/07/2024	3 mois 31/05/2024	1 an 31/08/2023	3 ans 31/08/2021	5 ans 30/08/2019	Depuis le 01/08/2019
Portefeuille	12,64%	0,64%	4,20%	17,50%	19,15%	49,23%	48,68%
Indice	12,77%	0,62%	4,25%	17,86%	20,48%	51,98%	51,47%
Ecart	-0,14%	0,02%	-0,05%	-0,36%	-1,33%	-2,75%	-2,79%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portefeuille	9,52%	-9,15%	28,03%	-2,68%	-
Indice	9,98%	-8,79%	28,48%	-2,23%	-
Ecart	-0,46%	-0,36%	-0,45%	-0,45%	-

* 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 garanties 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 de la classe : **29/06/2016**
 Eligibilité : -
 Eligible PEA : **Non**
 Affectation des sommes distribuables : **Capitalisation**
 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 de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation :
0,50%
 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	8,87%	12,16%	16,50%
Volatilité de l'indice	8,88%	12,13%	16,51%

* 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.

ACTIONS ■

Rencontrez l'équipe



Lionel Brafman
Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie



Marie-Charlotte Lebigue
Gérant de portefeuille principal



David Heard
Gérant suppléant

Commentaire de gestion

Le mois d'août est marqué par de forts mouvements des marchés d'action, une hausse surprise des taux d'intérêt de la Banque du Japon et des craintes de récession aux Etats-Unis dans un contexte géopolitique instable. La croissance donne des signes de ralentissement et l'inflation se rapproche de l'objectif des banques centrales. Après une forte chute la première semaine, les marchés d'action terminent en légère hausse, alors que les taux d'intérêts ont globalement baissé.

Le scénario de ralentissement marqué de l'économie qui était depuis plusieurs mois écarté par les investisseurs est revenu sur le devant de la scène. Ce changement de narratif, associé à la hausse surprise des taux de la Banque du Japon et la chute du marché japonais, ainsi qu'une dégradation des perspectives de certaines grandes valeurs américaines, ont entraîné une chute brutale des marchés d'action. En Europe, les marchés ont montré une certaine résilience en terminant le mois dans le vert. Le MSCI EMU a progressé de 3.95% en août, soutenu par des gains dans les secteurs de la consommation cyclique et de la technologie. MSCI Germany a enregistré une hausse de 4.7%. Le marché japonais a été très volatil en conséquence de la hausse des taux surprise de la BoJ et du renforcement du Yen en conséquence. La performance du MSCI Japan fut de 0.51%.

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice réplique la performance de 4 sous-indices sélectionnés et pondérés parmi les indices « Scientific Beta » conçus par l'Edhec Risk Institute (ERI) sur cet univers des actions de moyennes et grandes capitalisations des marchés développés. Ces indices de stratégie croisant 4 schémas de sélection de titres et 5 stratégies dites 'Smart beta'.

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
Total	-

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



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.