

AMUNDI S&P 500 ESG INDEX AU

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/10/2023

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : (C) 257,55 (USD)
(D) 162,55 (USD)

Date de VL et d'actif géré : 31/10/2023

Actif géré : 1 573,67 (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)



Risque le plus faible

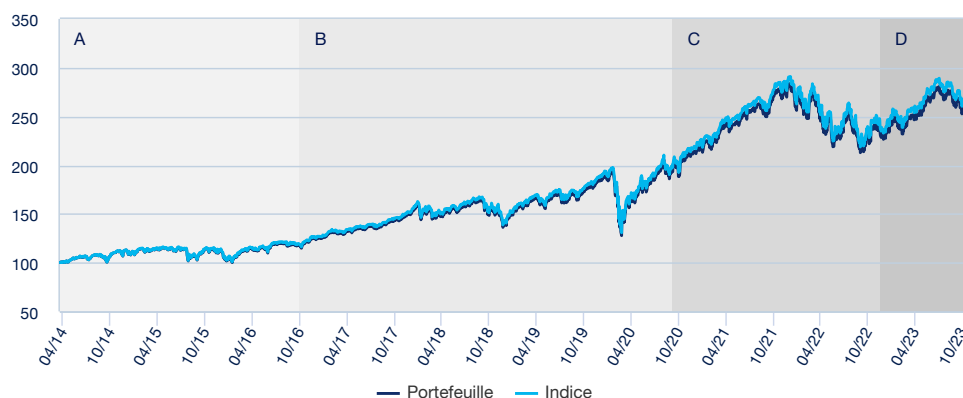
Risque le plus élevé

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.

« 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 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 30/12/2022	1 mois 29/09/2023	3 mois 31/07/2023	1 an 31/10/2022	3 ans 30/10/2020	5 ans 31/10/2018	Depuis le 17/04/2014
Portefeuille	12,03%	-1,90%	-8,33%	11,17%	36,67%	68,91%	157,37%
Indice	12,33%	-1,88%	-8,25%	11,50%	37,71%	70,96%	165,31%
Ecart	-0,30%	-0,03%	-0,07%	-0,34%	-1,03%	-2,06%	-7,94%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013
Portefeuille	-18,38%	31,72%	16,05%	31,50%	-6,05%	20,73%	10,56%	0,34%	-	-
Indice	-18,16%	31,95%	16,31%	31,82%	-5,75%	21,10%	11,23%	0,75%	-	-
Ecart	-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 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.

Notation Morningstar ©

Notation Morningstar "Overall" © : 4 étoiles

Catégorie Morningstar © :
ACTIONS AMÉRICAINES À GRANDE CAPITALISATION – MIXTE

Date de notation : 30/09/2023

Nombre de fonds de la catégorie : 1683

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	14,63%	17,50%	20,41%
Volatilité de l'indice	14,61%	17,42%	20,35%

* 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 & Multistratégie



Lionel Issom Nlep
Gérant de portefeuille principal



Jerome Gueguen
Gérant suppléant

Commentaire de gestion

L'économie américaine a multiplié les signes de vigueur en octobre : en début de mois, le rapport mensuel sur le marché du travail a fait état de 336 000 nouveaux emplois nets en septembre, soit un chiffre bien au-dessus des attentes, même si d'autres éléments ont été moins encourageants (dont un taux de chômage un peu au-dessus des attentes à 3,8%).

En fin de mois, les chiffres de la croissance économique du T3 ont montré une forte accélération avec une progression du PIB de 4,9% (en rythme annualisé) par rapport au T2, grâce, notamment, à la vigueur de la consommation.

Par ailleurs, malgré la forte hausse des taux d'intérêt, le marché immobilier a continué d'afficher une bonne résistance. Cependant, le climat des affaires est resté négatif dans l'industrie.

Les chiffres de l'inflation ont été mitigés : en septembre, la progression sur 12 mois de l'indice général des prix s'est maintenue à 3,7%, mais celle de l'indice sous-jacent a poursuivi sa décélération, à 4,1% (après 4,3% en août).

En fin de mois, la Réserve fédérale semblait considérer que le niveau de ses taux directeurs était désormais approprié pour permettre une poursuite de la désinflation, et les marchés ne s'attendaient pas à une hausse de taux supplémentaire début novembre.

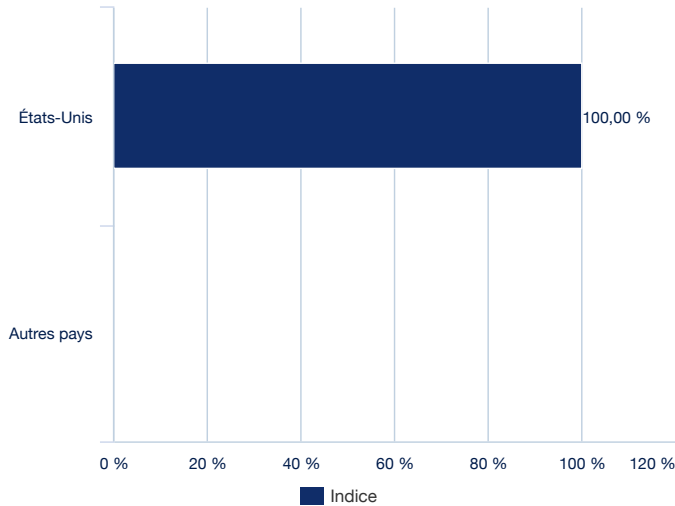
Les rendements des actions ont été négatifs dans tous les secteurs, les secteurs les moins performants ont été la consommation discrétionnaire, l'immobilier et l'industrie. Sur une base relative, les secteurs qui ont surperformé sur la période sont les biens de consommation de base, suivi par les services de communication et les technologies de l'information.

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.

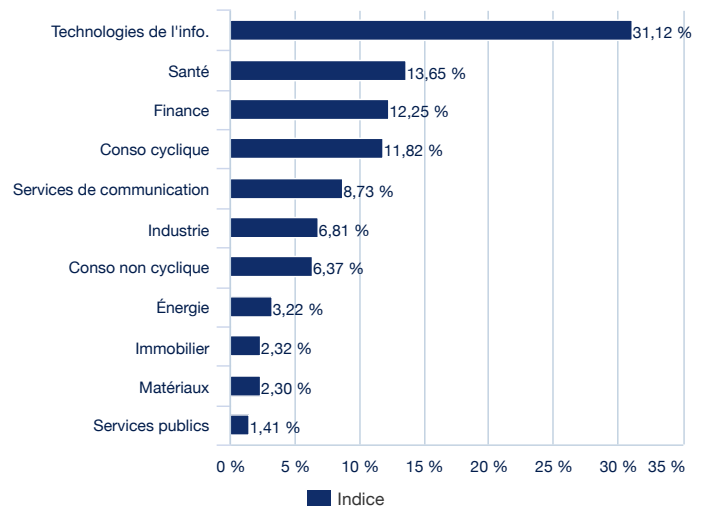
Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

Titre	% d'actifs (indice)
MICROSOFT CORP	9,61%
APPLE INC	9,60%
AMAZON.COM INC	4,62%
NVIDIA CORP	3,90%
ALPHABET INC CL A	2,83%
ALPHABET INC CL C	2,43%
TESLA INC	2,09%
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,88%
ELI LILLY & CO	1,73%
EXXON MOBIL CORP	1,63%
Total	40,33%

Secteurs 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.