

# AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT - AE

SYNTHESE DE  
GESTION

31/10/2021

ACTION ■

## Données clés (source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : (C) 217,01 ( EUR )  
(D) 221,90 ( EUR )

Date de VL et d'actif géré : 29/10/2021

Actif géré : 2 444,08 ( millions EUR )

Code ISIN : LU0389811372

Code Bloomberg : (C) CAIDXEC LX  
(D) CAIDXED LX

Indice de référence :

100% MSCI EMU ESG LEADERS SEL 5% CAPPED

## Objectif d'investissement

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 (SRR)



⬇ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

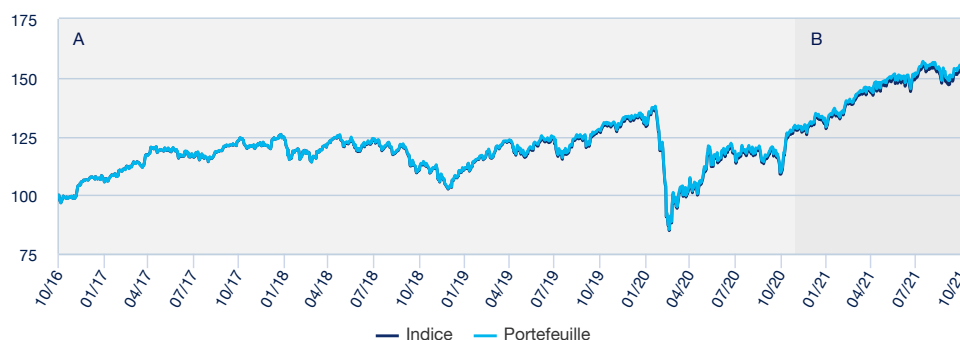
⬆ A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

Le SRR 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 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

### Evolution de la performance (VL) \*



A : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment a été l'indice MSCI EMU.

B : Depuis le début de cette période, l'indicateur de référence du compartiment est MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped

### Performances glissantes \*

Depuis le	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le
	31/12/2020	30/09/2021	30/07/2021	30/10/2020	31/10/2018	31/10/2016	23/09/2008
<b>Portefeuille</b>	19,64%	3,88%	2,98%	41,83%	38,46%	55,76%	117,98%
<b>Indice</b>	18,90%	3,87%	2,75%	41,30%	37,11%	53,86%	112,62%
<b>Ecart</b>	0,74%	0,01%	0,23%	0,53%	1,35%	1,90%	5,36%

### Performances calendaires \*

	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011
<b>Portefeuille</b>	-1,43%	28,56%	-14,78%	13,44%	3,64%	10,71%	4,64%	23,64%	19,51%	-15,89%
<b>Indice</b>	-1,48%	28,17%	-14,98%	13,39%	3,49%	10,75%	4,24%	23,45%	18,95%	-16,16%
<b>Ecart</b>	0,05%	0,39%	0,19%	0,05%	0,15%	-0,04%	0,40%	0,19%	0,56%	0,27%

\* 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 © :

**EUROZONE LARGE-CAP EQUITY**

Date de notation : 30/09/2021

Nombre de fonds de la catégorie : 1070

### Caractéristiques principales

Forme Juridique : SICAV

Date de création du compartiment/OPC : 29/06/2016

Date de création de la classe : 29/06/2016

Eligibilité : -

Enveloppe fiscale : **Eligible au PEA**

Eligible PEA : **Oui**

Affectation des sommes distribuables :

**(C) Capitalisation**

**(D) Distribution**

Souscription minimum: 1ère / suivantes :

**1 millième part(s)/action(s) / 1 millième part(s)/action(s)**

Frais d'entrée (maximum) : **4,50%**

Frais courants : **0,30% (prélevés 30/09/2020)**

Frais de sortie (maximum) : **0,00%**

Durée minimum d'investissement recommandée : **5 ans**

Commission de surperformance : **Non**

### Indicateur(s) glissant(s)

	1 an	3 ans	5 ans
<b>Volatilité du portefeuille</b>	13,85%	22,11%	18,85%
<b>Volatilité de l'indice</b>	13,68%	22,03%	18,79%

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 &amp; Multistratégie

**Vincent Masson**

Gérant de portefeuille senior - Index &amp; Multistratégies

**Jerome Gueguen**

Gérant suppléant

## Commentaire de gestion

Le marché européen se redresse (+4.6% pour le stoxx 600) après la baisse du mois de septembre, grâce à une nouvelle saison de publication de résultats trimestriels supérieurs aux attentes, et en dépit de la poursuite de la crise énergétique et de l'abaissement de prévision de croissance du FMI à +5.9% (vs +6% avant) à cause des problèmes de chaîne de production et de l'aggravation de la situation sanitaire pour les pays émergents. La prévision de croissance du FMI pour 2022 est maintenue à +4.9%.

En Europe les Utilities (+8.2%) profitent pour certains acteurs de la hausse des prix de l'énergie et du rallye de certains/certaines valeurs renouvelables alors que le secteur consumer product & services (+8.0%) profite d'une nouvelle série de très bonnes publications de résultats pour la plupart des acteurs du Luxe (LVMH +9.2%, L'Oréal +10.7%, Hermès +14.6%, Moncler +17.2%).

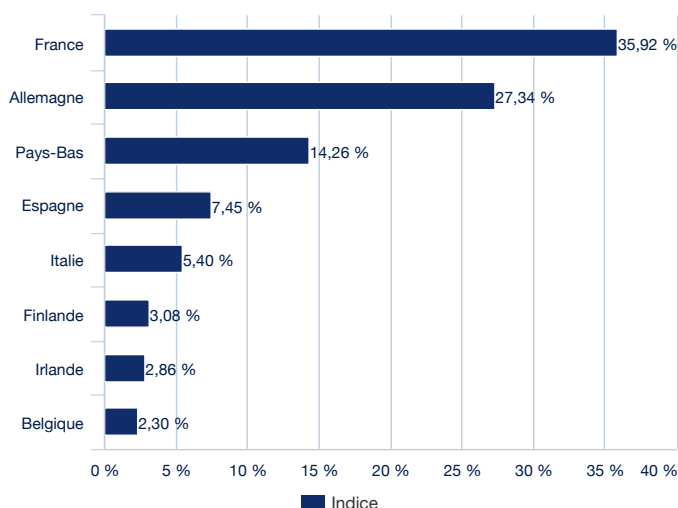
Le secteur des Telecoms (-3.8%), reste toujours pénalisé par des publications de résultats mitigés à l'instar de Telecom Italia (-9.2%) qui « warne » pour la seconde fois en 6 mois. Le secteur Travel & Leisure (-0.1%) reste pénalisé par certaines restrictions imposées par la crise sanitaire malgré quelques signes d'amélioration en termes de flux passagers et prévisions des sociétés.

## Données de l'indice

## 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.

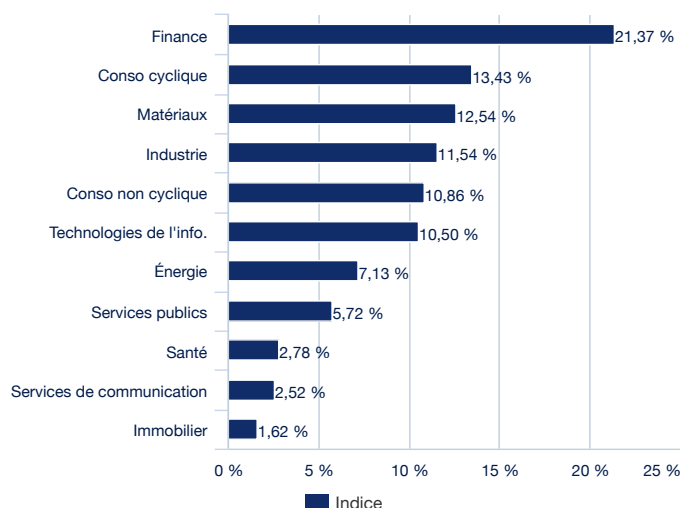
## Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



## Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

Titre	% d'actifs (indice)
ASML HOLDING NV	5,27%
SAP SE	5,03%
TOTALENERGIES SE	4,69%
L OREAL	4,30%
ALLIANZ SE-REG	3,59%
SCHNEIDER ELECT SE	3,48%
AIR LIQUIDE SA	2,95%
BNP PARIBAS	2,80%
IBERDROLA SA	2,63%
ENEL SPA	2,56%
<b>Total</b>	<b>37,31%</b>

## 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 sous la mention SYNTHESE DE GESTION en tête du document sauf mention contraire.