

AMUNDI S&P 500 CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB UCITS ETF

Acc

RENTA VARIABLE ■

INFORMES

Comunicación
Publicitaria

31/03/2024

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : **34,63 (USD)**
Fecha de valor liquidativo y activo gestionado :
28/03/2024
Activos : **3 968,06 (millones USD)**
Código ISIN : **IE00005FBC47**
Replication type : **Físico**
Índice de referencia :
**100% S&P 500 NET ZERO 2050 PARIS-ALIGNED
ESG+ INDEX**

Objetivo de inversión

El objetivo del Subfondo es reproducir la rentabilidad del S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG+ Index (el "Índice"). El Subfondo tiene como objetivo lograr un nivel de error de seguimiento del Subfondo y su Índice que normalmente no superará el 1 %.

Indicador de Riesgo (Fuente: Fund Admin)



Riesgo más bajo

Riesgo más alto

El indicador de riesgo presupone que usted mantendrá el producto durante 5 años. El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

Rentabilidades (Fuente: Fund Admin) - El rendimiento pasado no garantiza los resultados futuros

Evolución del resultado (VL) * (Fuente : Fund Admin)



Indicadores de riesgo (Fuente: Fund Admin)

	1 año	3 años	Desde el lanzamiento *
Volatilidad de la cartera	12,29%	17,75%	17,77%
Volatilidad del índice	12,29%	17,76%	17,78%
Tracking Error	0,04%	0,03%	0,03%
Ratio de Sharpe	2,19	0,46	0,76

* La volatilidad es un indicador estadístico que mide la amplitud de las variaciones de un activo respecto a su media. Ejemplo: unas variaciones diarias de +/- 1,5% en los mercados corresponden a una volatilidad anual del 25%. Tracking Error

Rentabilidades* (Fuente : Fund Admin)

Desde el	Desde el 29/12/2023	1 mes 29/02/2024	3 meses 29/12/2023	1 año 31/03/2023	3 años 31/03/2021	5 años -	Desde el 15/07/2020
Cartera	11,44%	3,03%	11,44%	32,44%	39,16%	-	73,13%
Índice	11,44%	3,03%	11,44%	32,47%	39,36%	-	73,66%
Diferencia	0,01%	0,00%	0,01%	-0,03%	-0,21%	-	-0,53%

Rentabilidades anuales* (Fuente : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Cartera	29,49%	-21,97%	-	-	-
Índice	29,54%	-21,95%	-	-	-
Diferencia	-0,05%	-0,02%	-	-	-

* Las rentabilidades arriba indicadas cubren periodos completos de 12 meses para cada año civil. Las rentabilidades pasadas no presuponen en modo alguno los resultados actuales ni futuros, y no garantizan los rendimientos venideros. Los eventuales beneficios o pérdidas no incluyen los gastos, comisiones o tasas soportados por el inversor en el momento de la emisión y la compra de participaciones (p.ej., impuestos, gastos de intermediación u otras comisiones aplicados por el intermediario financiero). Si las rentabilidades se calculan en una divisa distinta al euro, las fluctuaciones de los tipos de cambio (al alza o a la baja) pueden afectar los eventuales beneficios o pérdidas generados. La diferencia corresponde a la diferencia de rentabilidades de la cartera y del índice.

RENTA VARIABLE ■

Conozca al Equipo



Lionel Brafman
Responsable Gestión Índice & Multistrategy



Christophe Neves
Lead Portfolio Manager



Eric Alcaraz
Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG+ Index en un índice de renta variable que mide la rentabilidad de los valores de renta variable aptos del S&P 500 Index (el "índice principal"), seleccionados y ponderados para ser colectivamente compatibles con un escenario de calentamiento global de 1,5 °C. Además, incorpora una amplia gama de objetivos relacionados con el clima que cubren el riesgo de transición, las oportunidades del cambio climático y los riesgos físicos. El Índice principal es un índice de renta variable representativo de los principales valores negociados en Estados Unidos.

Características (Fuente : Amundi)

Clase de activo : **Renta variable**
Exposición : **EE.UU.**

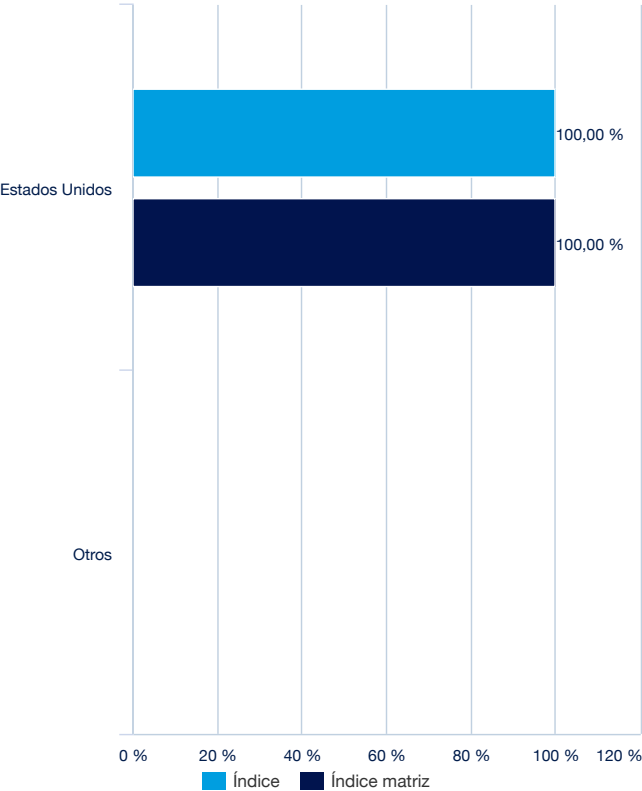
total de valores : **345**

Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)	% de activos (índice matriz)
MICROSOFT CORP	7,28%	7,09%
APPLE INC	6,01%	5,65%
NVIDIA CORP	4,96%	5,06%
AMAZON.COM INC	4,85%	3,74%
ALPHABET INC CL A	3,03%	2,02%
ALPHABET INC CL C	2,57%	1,70%
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,97%	2,42%
VISA INC-CLASS A SHARES	1,81%	1,00%
ELI LILLY & CO	1,72%	1,41%
MASTERCARD INC-CL A	1,56%	0,90%
Total	35,77%	31,00%

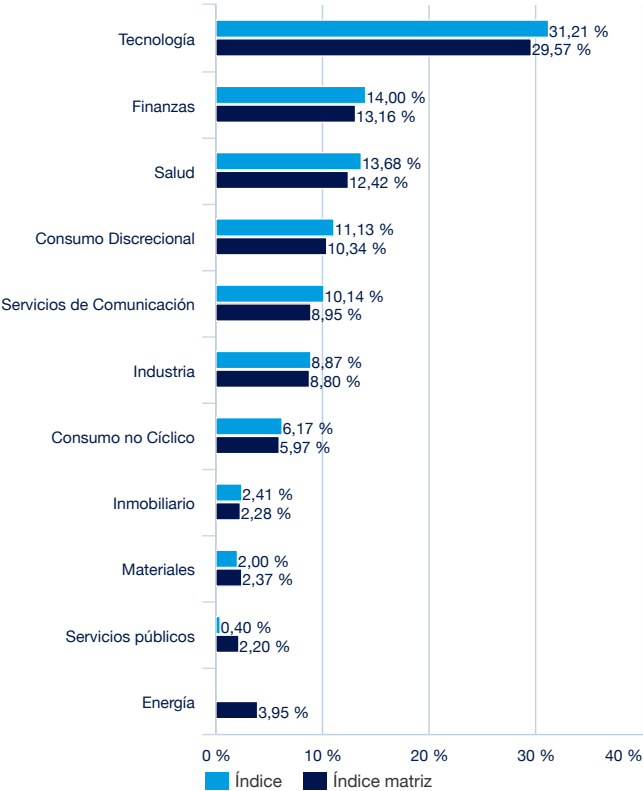
Índice matriz : **S&P 500**

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Índice matriz : **S&P 500**

Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



Índice matriz : **S&P 500**

RENTA VARIABLE

Inversión Socialmente Responsable (ISR)

El ISR traduce los objetivos del desarrollo sostenible en las decisiones de inversiones añadiendo los criterios Medioambientales, Sociales y de Gobernanza (ESG) además de los criterios financieros tradicionales.

Evaluación por criterio ESG (Fuente : Amundi)

	índice	Índice matriz
Calificación general	6,84	6,69
Medio ambiente	7,19	6,86
Social	5,09	5,13
Gobernanza	5,47	5,50

Índice matriz : S&P 500

Criterios ESG

Los criterios son criterios extra-financieros utilizados para evaluar las prácticas medioambientales, sociales y de gobernanza de las empresas.

Los riesgos y oportunidades medioambientales, sociales y de gobernanza se clasifican por grandes tendencias (por ejemplo, el cambio climático, la escasez de recursos, los cambios demográficos), así como por la naturaleza de las operaciones de la empresa.

Las puntuaciones siguen una escala de 0 a 10, siendo 10 la mejor nota.

«E» de Entorno o medio ambiente (cambio climático, recursos naturales, contaminación y residuos y oportunidades medioambientales)

«S» de Social (recursos humanos, fiabilidad de los productos, oposición de los grupos de interés y oportunidades sociales)

«G» de Gobernanza (gobierno corporativo y comportamiento de la empresa)

Fuente: los datos ESG brutos de las empresas proceden de la agencia MSCI.

Huella de carbono

Huella de carbono por millón de euros invertido

	índice	Índice matriz
Huella de carbono total en la cartera (índice/índice matriz) :	20,77	49,15



Índice matriz : S&P 500

Huella de carbono

Este indicador mide las emisiones de toneladas equivalentes de CO2 (tCO2e) por millón de euros invertidos.

Es un indicador de las emisiones generadas por la inversión en este portafolio.

Definición de los scopes :

- **Scope 1:** Totalidad de las emisiones directas procedentes de fuentes propiedad o bajo control de la empresa.
- **Scope 2:** Totalidad de las emisiones indirectas inducidas por la compra o la producción de electricidad, vapor o calor.
- **Scope 3:** Totalidad de todas las demás emisiones indirectas, previas o posteriores a la cadena de valor. Por motivos de solidez de los datos, en este informe hemos optado por utilizar únicamente una parte del scope 3: las emisiones previas correspondientes a proveedores de primer nivel. Los proveedores de primer nivel son aquellos con los que la empresa mantiene una relación privilegiada y en los que puede influir directamente.

Fuente : Los datos sobre emisiones de carbono proceden de Trucost. Corresponden a las emisiones anuales de las empresas y se expresan en toneladas equivalentes de CO2. Por ejemplo, agrupan los seis gases de efecto invernadero definidos en el Protocolo de Kioto, cuyas emisiones se convierten a potencial de calentamiento global (PRG) en equivalente de CO2.

Etiqueta ISR



RENTA VARIABLE ■

Características principales (Fuente : Amundi)

Forma jurídica	ICAV Irlandais
Normativa UCITS	OICVM
Sociedad gestora	Amundi Ireland Limited
Sub Delegación Financiera	HSBC Securities Services (Ireland) DAC
Custodio	HSBC Continental Europe
Auditor Externo	PRICEWATERHOUSECOOPERS
Fecha de creación	22/11/2023
Primer fecha de Valoración	15/07/2020
Divisa de referencia de la clase	USD
Clasificación	-
Asignación de los resultados	Participaciones de Capitalización
Código ISIN	IE000O5FBC47
Mínimo de suscripción mercado secundario	1 Participación(es)
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,07% (Estimados) - 22/11/2023
Periodo mínimo de inversión recomendado	5 años
Cierre fiscal	Diciembre
Código CNMV	-
Corredor principal	

Datos de cotización del ETF (Fuente : Amundi)

Sitio	Horarios	Divisa	Mnemo	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
Deutsche Börse	-	EUR	ZPA5	ZPA5 GY	ZPA5EUIV	ZPA5.DE	ZPA5EURINAV=SOLA
Deutsche Börse	-	USD	PABU	ZPA6 GY	PABUUSIV	ZPA5USD.DE	PABUUSDINAV=SOLA
Deutsche Börse	-	GBP	PABL	ZPA7 GY	PABLGBIV	ZPA5GBP.DE	PABLGBPINAV=SOLA
Borsa Italiana	-	EUR	PABUS	PABUS IM	ZPA5EUIV	PABUS.MI	ZPA5EURINAV=SOLA
Six Swiss Exchange	-	USD	PABU	PABU SW	PABUUSIV	PABU.S	PABUUSDINAV=SOLA
Nyse Euronext Paris	-	EUR	PABU	PABU FP	ZPA5EUIV	PABU.PA	ZPA5EURINAV=SOLA

Contacto

Contacto ETF venta

Francia & Luxemburgo	+33 (0)1 76 32 65 76
Alemania & Austria	+49 (0) 800 111 1928
Italia	+39 02 0065 2965
Suiza (Alemán)	+41 44 588 99 36
Suiza (Francés)	+41 22 316 01 51
UNITED KINGDOM (Retail)	+44 (0) 20 7 074 9598
UNITED KINGDOM (Instit)	+44 (0) 800 260 5644
Países Bajos	+31 20 794 04 79
Países Nórdicos	+46 8 5348 2271
Hong Kong	+65 64 39 93 50
España	+34 914 36 72 45

Contacto ETF Capital Market

Téléphone	+33 (0)1 76 32 19 93
Bloomberg IB Chat	Capital Markets Amundi ETF
	Capital Markets Amundi HK ETF

Contacto ETF Broker

BNP Paribas	+33 (0)1 40 14 60 01
Kepler Cheuvreux	+33 (0)1 53 65 35 25

Contacto Amundi

Amundi ETF
90 bd Pasteur
CS 21564
75 730 Paris Cedex 15 - France
Hotline : +33 (0)1 76 32 47 74
info@amundiETF.com

RENTA VARIABLE ■

Índices Proveedores

The Sub-Fund is neither sponsored, approved, sold nor recommended by Standard & Poor's or its subsidiaries ("S&P"). S&P makes no declaration or provide any condition or guarantee, explicit or implicit, to Sub-Fund shareholders or to any member of the public relating to investment opportunities in securities in general or in the particular Sub-Fund or about the ability of the S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index to track the yield of certain financial markets and/or sections of them and/or groups or categories of assets. The only relationship linking S&P to Amundi Asset Management is the granting of licences for certain registered trademarks or commercial marks and for the S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index that is defined, composed and calculated by S&P, without regard for pour Amundi Asset Management or for the Sub-Fund. S&P is not obliged to take account of the needs of Amundi Asset Management or the Sub-Fund shareholders when defining the composition of or calculating the S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index. S&P is not responsible and have not been party to the definition of prices and amounts in the Sub-Fund or the schedule for issuing or selling the Sub-Funds or in defining or calculating the equation for converting shares in the Sub-Funds into liquid assets. S&P have no obligations or responsibilities in terms of the administration, marketing or commercialisation of the Sub-Fund.

S&P does not guarantee the accuracy and/or comprehensiveness of the S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index or any data in it and will not be responsible for any error, omission or interruption relating to it. S&P makes no declaration or provide no conditions or guarantees, explicit or implicit, relating to the results that will be obtained by Amundi Asset Management, Sub-Fund shareholders or any other person or entity using the S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index or any data in it. S&P makes no declaration or give any condition or guarantee, explicit or implicit, and expressly deny any guarantee, market quality conditions or aptitude for an objective or specific use and any other guarantee or condition, explicit or implicit, relating to the S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index or any data in it. Without limiting what precedes, S&P will not be responsible for any special, punitive, indirect or consequent damage (including loss of profits) resulting from using the S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index or any other data in it, even if it was warned of the possibility that the said damage may occur.

Menciones legales

El presente documento se facilita a título informativo y en ningún caso constituye una recomendación, solicitud, oferta, consejo ni invitación de compra o venta de participaciones o acciones de los fondos de inversión colectiva, fondos de inversión de riesgo, SICAV ni compartimentos de SICAV o SPPICAV presentados en este documento («las IIC»), y en ningún caso debe interpretarse como tal. El presente documento no constituye la base de un contrato o compromiso de ninguna naturaleza. Toda la información contenida en este documento podrá ser modificada sin previo aviso. La sociedad gestora no asumirá ninguna responsabilidad, directa o indirecta, que pueda resultar del uso de la información contenida en este documento. La sociedad gestora no se hace responsable de las decisiones que se tomen sobre la base de esta información. La información contenida en el presente documento tiene un carácter confidencial y no podrá ser copiada, reproducida, modificada, traducida ni difundida sin el acuerdo previo por escrito de la sociedad gestora a ningún tercero ni en ningún país donde dicha difusión o uso sea contraria a las disposiciones legales y reglamentarias, o que imponga a la sociedad gestora o a sus fondos obligaciones de registro ante las autoridades de tutela de dichos países. No todas las IIC están sistemáticamente registradas en el país de jurisdicción de todos los inversores. Invertir implica riesgos: las rentabilidades pasadas de las IIC presentadas en este documento, así como las simulaciones realizadas sobre la base de estas últimas, no presuponen ni constituyen un indicador fiable de las rentabilidades futuras. Los valores de las participaciones o acciones de las IIC están sujetos a las fluctuaciones del mercado, de modo que las inversiones realizadas pueden variar al alza o a la baja. Por tanto, los suscriptores de IIC pueden perder todo o parte del capital inicialmente invertido. Previamente a cualquier suscripción, es responsabilidad de las personas interesadas por las IIC asegurarse de la compatibilidad de dicha suscripción con las leyes que la rigen, de las consecuencias fiscales de su inversión y de familiarizarse con los documentos reglamentarios en vigor de cada IIC. Salvo indicación contraria, la fuente de los datos del presente documento es la sociedad gestora. La fecha de los datos en este documento es la indicada en la parte superior del documento, a menos que se indique lo contrario.

Cierta información © 2021 MSCI ESG Research LLC. Reproducido con permiso. Aunque los proveedores de información de Amundi, incluidos, sin limitación, MSCI ESG Research LLC y sus filiales (las «Partes ESG»), obtienen datos (la «Información») de fuentes que consideran fiables, ninguna de las Partes ESG garantiza la originalidad, la exactitud ni/o la exhaustividad de los datos contenidos en el presente documento y rechazan expresamente todas las garantías, expresas o implícitas, incluidas las de calidad comercial y de adecuación a un uso particular. La Información sólo puede ser utilizada para su uso interno y no podrá reproducirse ni difundirse de ninguna forma, ni utilizarse como base o componente de ningún instrumento financiero, producto o índice. Además, ninguna Información podrá ser utilizada para determinar qué títulos comprar o vender o cuándo comprarlos o venderlos. Ninguna de las Partes ESG será responsable de los errores u omisiones relacionados con los datos contenidos en el presente documento, ni de posibles daños directos, indirectos, especiales, punitivos, consecutivos u otros daños (incluida la pérdida de beneficios), incluso en caso de notificación de la posibilidad de tales perjuicios.