

AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA - UCITS ETF DR - USD

INFORMES

Comunicación Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE ■

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : **649,66 (USD)**
 Fecha de valor liquidativo y activo gestionado : **28/03/2024**
 Activos : **40,13 (millones USD)**
 Código ISIN : **LU1602145200**
 Replication type : **Físico**
 Índice de referencia : **100% SCIENTIFIC BETA DEVELOPED MULTI-BETA MULTI-STRATEGY ERC**

Objetivo de inversión

El objetivo es replicar lo mejor posible la evolución del índice de estrategia Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy ERC ("el Índice de estrategia") cualquiera que sea su evolución, tanto al alza como a la baja. El Compartimento tiene por objeto alcanzar un nivel de tracking error del Compartimento y su índice que no sobrepasará normalmente un 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	11,25%	14,77%	18,53%
Volatilidad del índice	11,21%	14,76%	18,54%
Tracking Error	0,13%	0,11%	0,13%
Ratio de Sharpe	1,04	0,14	0,21

* 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	1 mes	3 meses	1 año	3 años	5 años	Desde el
	29/12/2023	29/02/2024	29/12/2023	31/03/2023	31/03/2021	29/03/2019	14/02/2018
Cartera	6,84%	3,91%	6,84%	17,24%	16,88%	45,63%	45,07%
Índice	7,00%	3,96%	7,00%	17,65%	18,02%	47,83%	47,59%
Diferencia	-0,16%	-0,05%	-0,16%	-0,41%	-1,14%	-2,21%	-2,52%

Rentabilidades anuales* (Fuente : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Cartera	13,54%	-14,69%	19,10%	6,27%	25,28%
Índice	13,84%	-14,40%	19,41%	6,57%	25,60%
Diferencia	-0,30%	-0,29%	-0,30%	-0,30%	-0,32%

* Las rentabilidades arriba indicadas cubren períodos 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



Marie-Charlotte Lebigue
Lead Portfolio Manager



David Heard
Gestor de cartera suplente

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice replica el rendimiento de 4 subíndices seleccionados y ponderados entre los índices "Scientific Beta" concebidos por Edhec Risk Institute (ERI) en este universo de renta variable de medianas y grandes capitalizaciones de los mercados desarrollados. Estos índices de estrategia que cruzan 4 esquemas de selección de títulos y de 5 estrategias dichas 'S

Características (Fuente : Amundi)

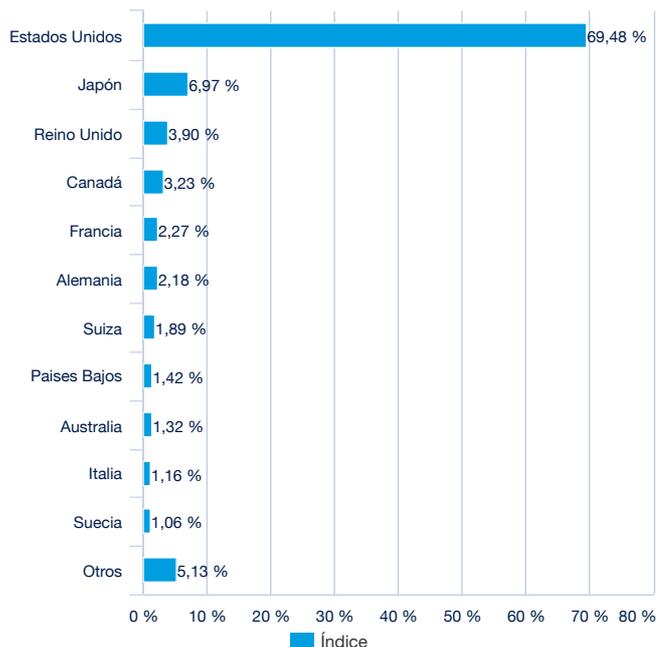
Clase de activo : **Renta variable**
Exposición : **Internacional**

total de valores : **1118**

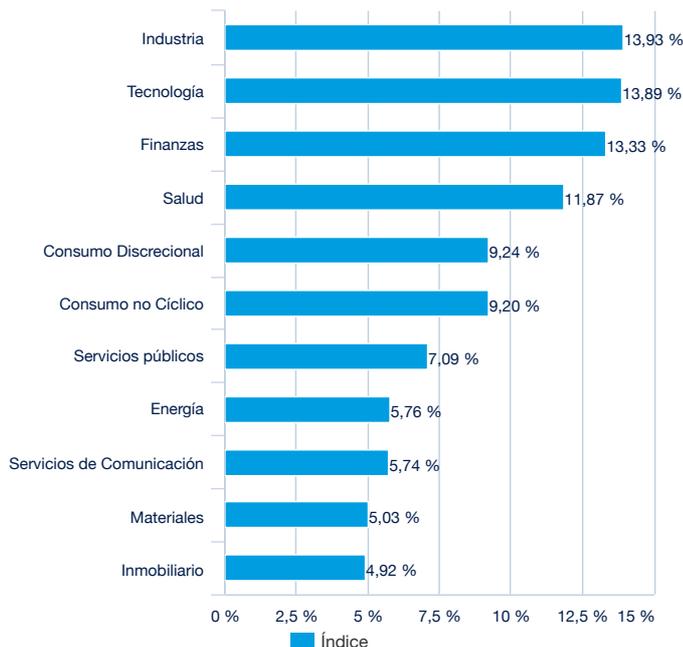
Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)
MERCK & CO. INC.	0,89%
VERTEX PHARMACEUTIC	0,64%
REGENERON PHARMACEUTICALS	0,52%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0,51%
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	0,50%
WALMART INC	0,49%
SYNOPSYS INC	0,49%
ALPHABET INC CL A	0,43%
EXXON MOBIL CORP	0,43%
WW GRAINGER INC	0,41%
Total	5,30%

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



RENTA VARIABLE ■

Características principales (Fuente : Amundi)

Forma jurídica	IICVM de Derecho luxemburgués
Normativa UCITS	OICVM
Sociedad gestora	Amundi Luxembourg SA
Sub Delegación Financiera	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Custodio	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Auditor Externo	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Fecha de creación	20/04/2017
Primer fecha de Valoración	14/02/2018
Divisa de referencia de la clase	USD
Clasificación	-
Asignación de los resultados	Participaciones de Capitalización
Código ISIN	LU1602145200
Mínimo de suscripción mercado secundario	1 Participación(es)
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,40% (realizado) - 08/02/2023
Periodo mínimo de inversión recomendado	5 años
Cierre fiscal	Diciembre
Código CNMV	-
Corredor principal	BNP Paribas

Datos de cotización del ETF (Fuente : Amundi)

Sitio	Horarios	Divisa	Mnemo	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
BIVA	-	USD	SMRU	SMRUN MM	-	-	-
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	SMRG	SMRG LN	-	SMRG.L	-
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	USD	SMRU	SMRU LN	ISMURU	SMRU.L	ISMURUINAV.PA
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	USD	SMRU	SMRU FP	ISMURU	SMRU.PA	ISMURUINAV.PA

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

Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC (EL "ÍNDICE STRATEGY") AL QUE AQUÍ SE HACE REFERENCIA ES PROPIEDAD DE EDHEC RISK INSTITUTE ASIA LTD ("ERIA") Y OBTUVO UNA LICENCIA PARA SU USO EN RELACIÓN CON AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA DENTRO DEL MARCO DE ACTIVIDAD DE ERI SCIENTIFIC BETA. EL ÍNDICE STRATEGY ES CALCULADO POR ERI SCIENTIFIC BETA BASÁNDOSE EN LA METODOLOGÍA DEL INSTITUTO EDHEC-RISK.

CADA PARTE RECONOCE Y ACUERDA QUE AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA NO ESTÁ FINANCIADO NI PROMOCIONADO POR ERIA. ERIA NO ASUME NINGUNA REPRESENTACIÓN DE NINGÚN TIPO, YA SEA EXPLÍCITA O IMPLÍCITA, Y POR LA PRESENTE RENUNCIA EXPRESAMENTE A TODAS LAS GARANTÍAS (INCLUIDAS, ENTRE OTRAS, LAS DE COMERCIALIZACIÓN O ADECUACIÓN A UN PROPÓSITO O USO PARTICULAR) RESPECTO AL ÍNDICE STRATEGY O A LOS DATOS ALLÍ INCLUIDOS O RELACIONADOS CON ÉL. EN CONCRETO RENUNCIA A LAS GARANTÍAS, YA SEAN REFERENTES A LA CALIDAD, A LA PRECISIÓN Y/O A LA INTEGRIDAD DEL ÍNDICE STRATEGY O A LOS DATOS ALLÍ INCLUIDOS, A LOS RESULTADOS OBTENIDOS DEL USO DEL ÍNDICE STRATEGY Y/O LA COMPOSICIÓN DEL ÍNDICE STRATEGY EN UN MOMENTO CONCRETO, EN UN DÍA DETERMINADO O EN OTRO ASPECTO; Y/O A LA SOLVENCIA DE CUALQUIER ENTIDAD, O A LA PROBABILIDAD DE QUE TENGA LUGAR UN EVENTO CREDITICIO O SIMILAR (NO IMPORTA CÓMO SE DEFINA) RESPECTO A UNA OBLIGACIÓN EN EL ÍNDICE STRATEGY EN UN MOMENTO CONCRETO, EN UN DÍA DETERMINADO O EN OTRO ASPECTO. ERIA NO SERÁ RESPONSABLE (YA SEA EN CASO DE NEGLIGENCIA O NO) FRENTE A LAS PARTES O CUALQUIER OTRA PERSONA POR NINGÚN ERROR EN EL ÍNDICE STRATEGY Y ERIA NO ESTÁ EN OBLIGACIÓN DE NOTIFICAR A LAS PARTES O A CUALQUIER OTRA PERSONA SOBRE CUALQUIER ERROR AHÍ EXISTENTE. ERIA NO ASUME NINGUNA REPRESENTACIÓN DE NINGÚN TIPO, YA SEA EXPLÍCITA O IMPLÍCITA, EN RELACIÓN CON LA CONVENIENCIA DE COMPRA O VENTA DE AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA. TAMPOCO SE HACE RESPONSABLE DE LA CAPACIDAD DEL ÍNDICE STRATEGY PARA SUPERVISAR LA RENTABILIDAD DE LOS MERCADOS PERTINENTES, NI DE OTROS ASUNTOS RELACIONADOS CON EL ÍNDICE STRATEGY O CON CUALQUIER OPERACIÓN O PRODUCTO AL RESPECTO. ERIA NO ASUME LOS RIESGOS EN RELACIÓN CON LO EXPUESTO. ERIA NO TIENE LA OBLIGACIÓN DE CONSIDERAR LAS NECESIDADES DE NINGUNA PARTE A LA HORA DE DETERMINAR, COMPONER O CALCULAR EL ÍNDICE STRATEGY. NI ERIA NI NINGUNA PARTE QUE COMPRE O VENDA AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA TENDRÁ RESPONSABILIDAD SOBRE NINGUNA PARTE POR ACTUAR O NO JUNTO A ERIA RESPECTO A LA DETERMINACIÓN, EL AJUSTE, EL CÁLCULO O EL MANTENIMIENTO DEL ÍNDICE STRATEGY.

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.

Documento dirigido exclusivamente a inversores institucionales, profesionales, cualificados o sofisticados y distribuidores. No debe destinarse al público en general, a clientela privada ni a los particulares en el sentido de cualquier jurisdicción, ni tampoco a los ciudadanos de Estados Unidos. En la Unión Europea se dirige a inversores «Profesionales» en el sentido de la Directiva 2004/39/CE de 21 de abril de 2004 «MiFID» o, en su caso, en el sentido de cada reglamentación local y, en la medida que se incluya la oferta en Suiza, a «inversores cualificados» en el sentido de las disposiciones de la Ley sobre inversiones colectivas (CISA), la Ordenanza sobre inversiones colectivas de 22 de noviembre de 2006 (CISO) y la Circular FINMA 08/8 en el sentido de la legislación sobre inversiones colectivas de 20 de noviembre de 2008. Este documento no deberá facilitarse en ningún caso en la Unión Europea a inversores no «Profesionales» en el sentido de MiFID o en el sentido de cada reglamentación local, o en Suiza a inversores que no respondan a la definición de «inversores cualificados» en el sentido de la legislación y de la reglamentación aplicable.