

# AMUNDI DAX 50 ESG UCITS ETF DR - EUR

REPORT  
MENSILE

31/03/2024

## Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : **65,65 ( EUR )**  
 Data di valorizzazione : **28/03/2024**  
 Patrimonio in gestione : **19,41 ( milioni EUR )**  
 Codice ISIN : **LU2240851688**  
 Tipo di replica : **Fisico**  
 Benchmark : **100% DAX 50 ESG**

## Obiettivo di investimento

AMUNDI DAX 50 ESG ha l'obiettivo di replicare, nel modo più accurato possibile, la performance dell'indice DAX 50 ESG.  
 Il comparto consente di prendere un'esposizione alle 50 più grandi aziende tedesche, escludendo quelle non conformi alle norme internazionali (definite da Sustainalytics) e quelle coinvolte nelle armi controverse, i contratti militari, il tabacco, l'energia nucleare e il carbone.

## Indicatore di rischio(Fonte : Fund Admin)



Rischio più basso

Rischio più alto

L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 5 anni.  
 L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra incapacità di pagarvi quanto dovuto.

## Performance (Fonte : Fund Admin) - I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri

### Performance del fondo \* (Fonte : Fund Admin)



### Indicatori di rischio (Fonte : Fund Admin)

|                                 | 1 anno | 3 anni | Data di lancio * |
|---------------------------------|--------|--------|------------------|
| <b>Volatilità</b>               | 13,03% | 16,30% | 16,16%           |
| <b>Volatilità dei benchmark</b> | 13,04% | 16,30% | 16,16%           |
| <b>Tracking Error ex-post</b>   | 0,18%  | 0,24%  | 0,22%            |
| <b>Sharpe Ratio</b>             | 0,93   | 0,25   | 0,45             |

\* La volatilità è un indicatore statistico che misura l'ampiezza delle variazioni di un portafoglio rispetto alla sua media. Esempio: variazioni giornaliere di +/- 1,5% sui mercati corrispondono ad una volatilità annua del 25%.  
 L'indicatore Tracking Error misura la differenza di rendimento tra il fondo e l'indice

### Performance\* (Fonte : Fund Admin)

| A partire dal      | Da inizio anno | 1 mese     | 3 mesi     | 1 anno     | 3 anni     | 5 anni | Da inizio gestione |
|--------------------|----------------|------------|------------|------------|------------|--------|--------------------|
|                    | 29/12/2023     | 29/02/2024 | 29/12/2023 | 31/03/2023 | 31/03/2021 | -      | 24/11/2020         |
| <b>Portafoglio</b> | 8,61%          | 4,03%      | 8,61%      | 15,72%     | 17,41%     | -      | 31,30%             |
| <b>Benchmark</b>   | 8,60%          | 4,03%      | 8,60%      | 15,45%     | 16,42%     | -      | 30,25%             |
| <b>Scostamento</b> | 0,01%          | 0,00%      | 0,01%      | 0,27%      | 0,99%      | -      | 1,05%              |

### Performance annuale\* (Fonte : Fund Admin)

|                    | 2023   | 2022    | 2021   | 2020 | 2019 |
|--------------------|--------|---------|--------|------|------|
| <b>Portafoglio</b> | 19,66% | -15,17% | 15,25% | -    | -    |
| <b>Benchmark</b>   | 19,38% | -15,39% | 14,88% | -    | -    |
| <b>Scostamento</b> | 0,28%  | 0,22%   | 0,37%  | -    | -    |

\* Le performance sopra indicate si riferiscono a periodi completi di 12 mesi per ogni anno civile. **Le performance passate non sono assolutamente indicative dei risultati attuali e futuri e non garantiscono prossimi rendimenti.** I guadagni o le perdite eventuali non tengono conto delle spese, delle commissioni e delle imposte eventualmente sostenute dall'investitore al momento dell'emissione o del riscatto delle quote (es. tasse, spese di intermediazione o altre commissioni prelevate dall'intermediario finanziario...). Se le performance sono calcolate in una valuta diversa dall'euro, i guadagni o le perdite eventualmente generate possono essere influenzate dalle oscillazioni dei tassi di cambio (sia in rialzo che in ribasso). Lo scostamento corrisponde alla differenza di performance del portafoglio e dell'indice.

## Gestore del Fondo

**Lionel Brafman**

Responsabile gestione Indice &amp; Multistrategy

**Jerome Gueguen**

Lead Portfolio Manager

**Vincent Masson**

Gestore di portafoglio supplente

## Dati dell'indice (Fonte : Amundi)

## Descrizione

Il DAX 50 ESG replica il rendimento dei 50 titoli azionari del mercato tedesco più grandi e liquidi, che generano risultati relativamente buoni secondo i criteri ambientali, sociali e di governance. L'indice è composto da titoli inclusi nell'indice HDAX, rappresentativo delle grandi e medie imprese negoziate sul mercato azionario tedesco e aventi sede legale o operativa in Germania.

## Caratteristiche (Fonte : Amundi)

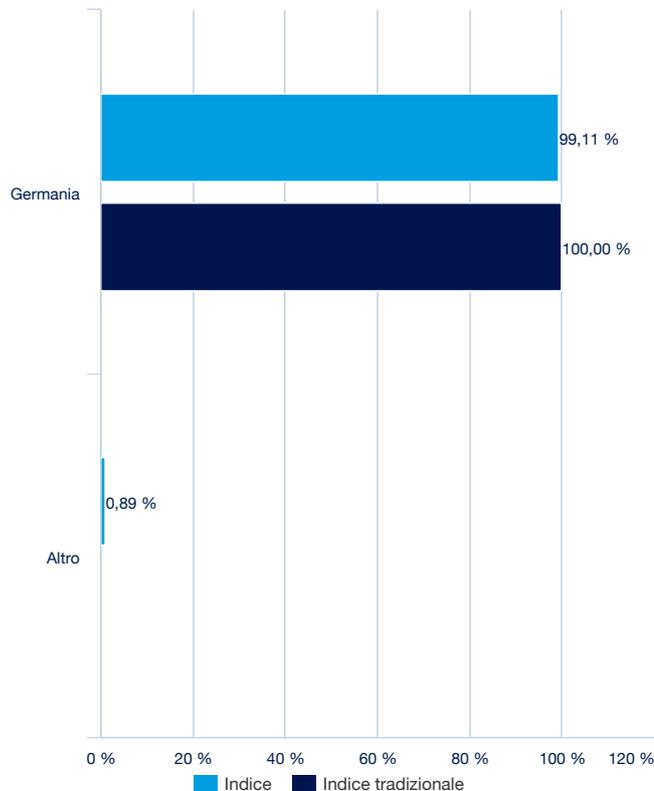
Classe di investimento : **Azionario**Esposizione : **Europa**Valuta di riferimento dell'indice : **EUR**Numero di titoli : **50**

## Primi dieci titoli dell'indice (Fonte : Amundi)

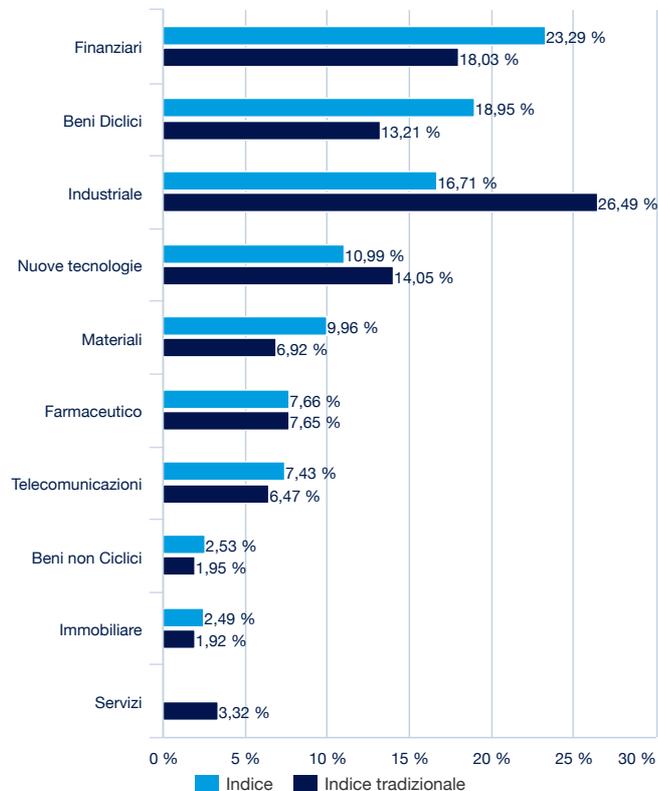
|                              | % del peso sul Benchmark | % di attivi (Indice tradizionale) |
|------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|
| ALLIANZ SE-REG               | 7,35%                    | 7,30%                             |
| DEUTSCHE TELEKOM NAM (XETRA) | 6,91%                    | 5,24%                             |
| SAP SE / XETRA               | 6,88%                    | 9,80%                             |
| SIEMENS AG-REG               | 6,61%                    | 8,93%                             |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 6,16%                    | 4,14%                             |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG       | 5,89%                    | 3,96%                             |
| BASF SE XETRA                | 4,71%                    | 3,17%                             |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 4,11%                    | 2,76%                             |
| DHL GROUP (XETRA)            | 3,83%                    | 2,58%                             |
| DEUTSCHE BOERSE AG           | 3,60%                    | 2,42%                             |
| <b>Totale</b>                | <b>56,03%</b>            | <b>50,31%</b>                     |

Indice tradizionale : **HDAX**

## Ripartizione geografica (Fonte : Amundi)

Indice tradizionale : **HDAX**

## Ripartizione settoriale (Fonte : Amundi)

Indice tradizionale : **HDAX**

**Investimenti Socialmente Responsabili (ISR)**

L'Investimento Socialmente Responsabile (ISR) è la pratica secondo la quale considerazioni di ordine ambientale, sociale o etico vengono introdotte nel processo decisionale di scelta o di mantenimento di un investimento, nonché nell'esercizio dei diritti connessi alla proprietà dei titoli. L'ISR, dunque, introduce nel sistema di valutazione dei dati finanziari l'attenzione ad elementi non finanziari, fino a poco tempo fa non considerati nelle analisi economico-finanziarie tradizionali. Questa integrazione extra-finanziaria è comunemente conosciuta con l'acronimo ESG.

**Valutazione in base ai criteri ESG (Fonte : Amundi)**

|                       | Indice | Indice tradizionale |
|-----------------------|--------|---------------------|
| <b>Rating Globale</b> | 7,46   | 7,42                |
| <b>Environment</b>    | 7,42   | 6,98                |
| <b>Sociale</b>        | 5,06   | 5,03                |
| <b>Governance</b>     | 5,70   | 5,75                |

Indice tradizionale : **HDAX**

**Criteri ESG**

I criteri sono criteri extra-finanziari utilizzati per valutare le pratiche ambientali, sociali e di governance delle imprese.

I rischi e le opportunità ambientali, sociali e di governance sono ordinati in base alle grandi tendenze (ad esempio, i mutamenti climatici, la rarità delle risorse, i cambiamenti demografici) e alla natura delle attività dell'impresa.

I punteggi si collocano su una scala compresa tra 0 e 10 (10 è il punteggio migliore).

**"E" per Environment** (mutamenti climatici, risorse naturali, inquinamento e rifiuti, opportunità ambientali)

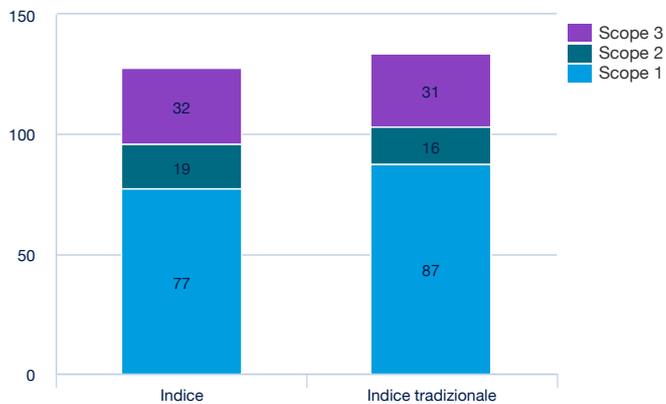
**"S" per Social** (risorse umane, affidabilità dei prodotti, opposizione degli stakeholder e opportunità sociali)

**"G" per Governance** (governance e comportamento d'impresa)

Fonte: I dati ESG grezzi delle imprese sono forniti dall'agenzia MSCI.

**Intensità di carbonio****Impronta di carbonio per milioni di euro investiti**

|   | Indice | Indice tradizionale |
|---|--------|---------------------|
| Intensità di carbonio totale del portafoglio (Indice/Indice tradizionale) : | 129,18 | 135,25              |



Indice tradizionale : **HDAX**

**Intensità di carbonio**

La carbon footprint (letteralmente, "impronta di carbonio") è un parametro che viene utilizzato per stimare le emissioni di gas serra espresse in tonnellate di CO2 (tCO2e) per milione di euro investito.

Rappresenta un indicatore delle emissioni generate dagli investimenti di questo portafoglio.

**Definizione degli Scope :**

- **Scope 1** : L'insieme delle emissioni dirette provenienti da fonti detenute o controllate dall'impresa.

- **Scope 2** : L'insieme delle emissioni indirette indotte dall'acquisto o dalla produzione di elettricità, vapore o calore.

- **Scope 3** : L'insieme di tutte le altre emissioni indirette, a monte/valle della catena di valore. Per motivi di robustezza dei dati, in questo reporting si è scelto di utilizzare solo una parte dello Scope 3: le emissioni a monte legate ai fornitori di primo livello. I fornitori di primo livello sono quelli con i quali l'impresa ha un rapporto privilegiato e sui quali più influire direttamente.

Fonte: I dati sulle emissioni di carbonio sono forniti da Trucost. Essi corrispondono alle emissioni annuali delle imprese e sono espressi in tonnellate di CO2 equivalente. In altre parole, riuniscono i sei gas ad effetto serra definiti nel Protocollo di Kyoto, le cui emissioni sono convertite in potenziale di riscaldamento globale (PRG) in CO2 equivalente.

**Caratteristiche principali (Fonte : Amundi)**

|   |                                   |
|---|-----------------------------------|
| Forma giuridica                             | OICVM di diritto lussemburghese   |
| Normativa europea                           | OICVM                             |
| Società di gestione                         | Amundi Luxembourg SA              |
| Agente amministrativo                       | CACEIS Bank, Luxembourg Branch    |
| Banca depositaria                           | CACEIS Bank, Luxembourg Branch    |
| Revisore dei Conti                          | PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG |
| Data di lancio                              | 24/11/2020                        |
| Prima data di NAV                           | 24/11/2020                        |
| Valuta di riferimento della classe          | EUR                               |
| Classificazione                             | -                                 |
| Tipologia dei dividendi                     | Az. ad Accumulazione              |
| Codice ISIN                                 | LU2240851688                      |
| Minimo di sottoscrizione mercato secondario | 1 Azione/quota                    |
| Frequenza di calcolo della quota            | Giornaliera                       |
| Spese correnti                              | 0,15% ( prelevati ) - 08/02/2023  |
| Orizzonte d'investimento minimo consigliato | 5 anni                            |
| Chiusura fiscale                            | Dicembre                          |
| Market Maker ufficiale                      | BNP Paribas                       |

**Dati di negoziazione dell'ETF (Fonte : Amundi)**

| Piazza             | Orario       | Valuta | Codice | Ticker Bloomberg | INAV Bloomberg | RIC Reuters | INAV Reuters |
|--------------------|--------------|--------|--------|------------------|----------------|-------------|--------------|
| Borsa Italiana     | 9:00 - 17:30 | EUR    | DAXESG | DAXESG IM        | IDECD          | DAXESG.MI   | IDECDINAV.PA |
| Deutsche Börse     | 9:00 - 17:30 | EUR    | DECD   | DECD GY          | IDECD          | DECD.DE     | IDECDINAV.PA |
| Six Swiss Exchange | 9:00 - 17:30 | EUR    | DESG   | DESG SW          | IDECD          | DESG.S      | IDECDINAV.PA |

**Contatti****Contatti commerciali ETF**

|                         |                       |
|-------------------------|-----------------------|
| Francia & Lussemburgo   | +33 (0)1 76 32 65 76  |
| Germania & Austria      | +49 (0) 800 111 1928  |
| Italia                  | +39 02 0065 2965      |
| Svizzera (Tedesco)      | +41 44 588 99 36      |
| Svizzera (Francese)     | +41 22 316 01 51      |
| UNITED KINGDOM (Retail) | +44 (0) 20 7 074 9598 |
| UNITED KINGDOM (Instit) | +44 (0) 800 260 5644  |
| Olanda                  | +31 20 794 04 79      |
| Paesi nordici           | +46 8 5348 2271       |
| Hong Kong               | +65 64 39 93 50       |
| Spagna                  | +34 914 36 72 45      |

**Contatti ETF Capital Market**

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

**Contatti Brokers ETF**

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

**Sede centrale**

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

## Dati Indici

STOXX e i suoi concessionari di licenza (i "Concessionari di licenza") non hanno alcun rapporto con Amundi Asset Management, ad eccezione della concessione in licenza dell'Indice DAX 50 ESG® e dei relativi marchi per l'utilizzo in relazione ad AMUNDI DAX 50 ESG. STOXX e i suoi Concessionari di licenza non: Sponsorizzano, avallano, vendono o promuovono AMUNDI DAX 50 ESG. Raccomandano a chiunque di investire in AMUNDI DAX 50 ESG o in qualsiasi altro titolo. Hanno alcun tipo di responsabilità o incombenza in relazione a qualsiasi decisione da intraprendere circa la tempistica, l'importo o il prezzo di AMUNDI DAX 50 ESG. Hanno alcun tipo di responsabilità o incombenza in relazione all'amministrazione, alla gestione o alla commercializzazione di AMUNDI DAX 50 ESG. Considerano le esigenze di AMUNDI DAX 50 ESG o dei titolari di AMUNDI DAX 50 ESG nello stabilire, comporre o calcolare l'Indice DAX 50 ESG e non hanno alcun obbligo in tal senso. STOXX e i suoi Concessionari di licenza non avranno alcuna responsabilità in relazione ad AMUNDI DAX 50 ESG. In particolare, STOXX e i suoi Concessionari di licenza non rilasciano alcuna garanzia, esplicita o implicita, e declinano qualsiasi garanzia in relazione a: I risultati che devono essere ottenuti da AMUNDI DAX 50 ESG, il titolare di AMUNDI DAX 50 ESG o da qualsiasi altra persona in relazione all'utilizzo dell'Indice DAX 50 ESG e dei dati inclusi nell'Indice DAX 50 ESG®; L'accuratezza o la completezza dell'Indice DAX 50 ESG e dei suoi dati; La commerciabilità e l'idoneità ad un particolare scopo o utilizzo dell'Indice DAX 50 ESG® e dei suoi dati; STOXX e i suoi Concessionari di licenza non si assumono alcuna responsabilità per eventuali errori, omissioni o interruzioni dell'Indice DAX 50 ESG® o dei suoi dati; In nessun caso STOXX o i suoi Concessionari di licenza saranno ritenuti responsabili per perdite di profitti o danni o perdite indiretti, punitivi, speciali o consequenziali, anche se STOXX o i suoi Concessionari di licenza sanno che potrebbero verificarsi. L'accordo di licenza tra Amundi Asset Management e STOXX è esclusivamente a loro beneficio e non a beneficio dei proprietari di AMUNDI DAX 50 ESG o di qualsiasi altra terza parte.

## Informazioni Legali / Disclaimer

Il presente documento è fornito a puro titolo informativo e non costituisce in alcun caso una raccomandazione, una sollecitazione o un'offerta, un consiglio o un invito all'acquisto o alla vendita di quote o azioni di FCI, FCIA, SICAV, comparto di SICAV e SPPICAV, presentati in questo documento ("gli OIC"), e non deve essere assolutamente interpretato come tale. Il presente documento non costituisce la base di un contratto o di un impegno di qualsivoglia natura. Tutte le informazioni ivi contenute possono essere modificate senza preavviso. La società di gestione declina qualsiasi responsabilità, diretta o indiretta, che possa derivare dall'utilizzo delle informazioni contenute nel presente informazioni. La società di gestione non può essere ritenuta in alcun caso responsabile delle decisioni assunte in base a queste informazioni. Le informazioni ivi contenute sono comunicate in via riservata e non devono essere copiate, riprodotte, modificate, tradotte o divulgate senza il preventivo accordo scritto della società di gestione, a terzi o in paesi in cui tale divulgazione o utilizzo sia contrario alle disposizioni legali e normative o imponga alla società di gestione o ai suoi fondi di conformarsi ad obblighi di registrazione presso autorità di tutela di questi paesi. Non tutti gli OIC sono sistematicamente registrati nel paese di giurisdizione di tutti gli investitori. L'attività d'investimento implica determinati rischi: le performance passate degli OIC, riportate nel presente documento, e le simulazioni realizzate in base ad esse non costituiscono un indicatore affidabile delle future performance. Esse non sono quindi indicative delle performance future degli OIC. I valori delle quote o delle azioni degli OIC sono soggetti alle oscillazioni del mercato; gli investimenti realizzati possono quindi variare sia al ribasso che in rialzo. Di conseguenza, i sottoscrittori degli OIC possono perdere la totalità o una parte del capitale inizialmente investito. Prima di procedere a qualsiasi sottoscrizione, le persone interessate agli OIC devono verificare la compatibilità di tale sottoscrizione con le leggi alle quali sono soggette e le conseguenze fiscali di un investimento di questo tipo, e devono prendere visione dei documenti normativi vigenti di ogni OIC. La fonte dei dati del presente documento è la società di gestione, salvo diversa indicazione. La data dei dati contenuti nel presente documento è quella indicata in testa al documento, salvo diversa indicazione.

Questo documento è rivolto ai soli investitori e distributori professionali, istituzionali o qualificati. Non è diretto al pubblico generico, clienti privati o investitori "retail" di qualsiasi giurisdizione e nemmeno ai residenti USA. Inoltre, ogni investitore dovrebbe essere, nell'Unione Europea, un investitore "professionale" così definito nella Direttiva 2004/39/CE del 21/04/2004 sugli strumenti finanziari (MIFID) o così indicato nelle regolamentazioni locali e, per quanto riguarda l'offerta in Svizzera, un "investitore qualificato" come previsto dalle Ordinanze Swiss Collective Investment Schemes del 23/06/2006 (CISA), Swiss Collective Investment Schemes del 22/11/2006 (CISO) e la circolare FINMA sulle offerte pubbliche interna alla legislazione sugli strumenti di investimento collettivo del 20/11/2008. In nessun caso questo documento può essere distribuito nell'Unione Europea a investitori "non professionali" come definiti dalla MIFID o da locali regolamentazioni, o in Svizzera agli investitori che non corrispondono alla definizione di "investitori qualificati" così definiti nella legislazione e regolamentazione in vigore.

Alcune informazioni © 2021 MSCI ESG Research LLC. Riproduzione autorizzata. Benché i provider di informazioni di Amundi, compresi (ma senza alcun intento limitativo) MSCI ESG Research LLC e le sue affiliate (le "Parti ESG"), ottengano informazioni (le "Informazioni") presso fonti ritenute affidabili, nessuna delle Parti ESG garantisce l'originalità, l'esattezza e/o la completezza dei dati contenuti nel presente documento e declinano specificatamente tutte le garanzie espresse o implicite, comprese quelle di commerciabilità e di adeguatezza ad un uso particolare. Le Informazioni possono essere esclusivamente utilizzare per il Vostro uso interno, non possono essere riprodotte né ritrasmesse in qualsivoglia forma e non possono essere utilizzate come base o componente di qualsiasi strumento finanziario, prodotto o indice. Inoltre, nessuna delle Informazioni può essere impiegata in sé per determinare quali titoli acquistare o vendere oppure quando acquistarli/venderli. Nessuna delle Parti ESG sarà ritenuta responsabile di errori od omissioni in relazione ai dati contenuti nel presente documento, né di eventuali danni diretti, indiretti, speciali, punitivi, conseguenti o di altra natura (compresi i mancati profitti), anche in caso di notifica della possibilità di tali danni.