

# Amundi PEA MSCI USA ESG Leaders UCITS ETF - EUR

REPORT  
MENSILE

31/03/2024

## Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : **627,98 (EUR)**  
Data di valorizzazione : **28/03/2024**  
Patrimonio in gestione : **1 121,01 (milioni EUR)**  
Codice ISIN : **LU1681042864**  
Tipo di replica : **Sintetico**  
Benchmark :  
**100% MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% ISSUER CAP**

## Obiettivo di investimento

L'obiettivo del presente Comparto consiste nel replicare il rendimento dell'Indice MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped e minimizzare il tracking error tra il valore patrimoniale netto del Comparto e il rendimento dell'Indice.  
Il Comparto si prefigge di conseguire un livello di tracking error del Comparto e del suo indice di norma non superiore all'1%.

## Indicatore di rischio(Fonte : Fund Admin)



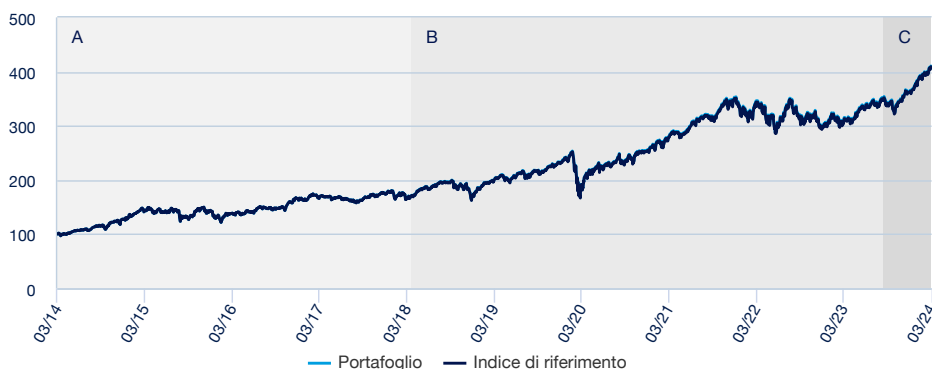
Rischio più basso

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)



A : Sur la base des performances réalisées depuis la date de lancement du Fonds français « AMUNDI ETF MSCI USA UCITS ETF » géré par Amundi Asset Management et absorbé par « AMUNDI MSCI USA » le 18.04.2018.

B : Performance del Comparto dalla data di lancio

C : Since the beginning of this period, the reference indicator of the Sub-Fund is MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped

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

|                    | Da inizio anno | 1 mese     | 3 mesi     | 1 anno     | 3 anni     | 5 anni     | Da inizio gestione |
|--------------------|----------------|------------|------------|------------|------------|------------|--------------------|
| A partire dal      | 29/12/2023     | 29/02/2024 | 29/12/2023 | 31/03/2023 | 31/03/2021 | 29/03/2019 | 04/12/2008         |
| <b>Portafoglio</b> | 12,80%         | 3,44%      | 12,80%     | 30,21%     | 45,95%     | 104,49%    | 810,64%            |
| <b>Benchmark</b>   | 12,99%         | 3,50%      | 12,99%     | 30,71%     | 46,35%     | 104,65%    | 816,97%            |
| <b>Scostamento</b> | -0,19%         | -0,05%     | -0,19%     | -0,50%     | -0,40%     | -0,17%     | -6,33%             |

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

|                    | 2023   | 2022    | 2021   | 2020   | 2019   | 2018   | 2017  | 2016   | 2015   | 2014   |
|--------------------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|
| <b>Portafoglio</b> | 22,00% | -14,55% | 36,19% | 10,85% | 33,42% | -0,09% | 6,67% | 14,29% | 12,11% | 28,28% |
| <b>Benchmark</b>   | 22,27% | -14,59% | 36,06% | 10,75% | 33,28% | -0,25% | 6,45% | 14,21% | 12,16% | 28,33% |
| <b>Scostamento</b> | -0,27% | 0,04%   | 0,13%  | 0,10%  | 0,13%  | 0,17%  | 0,22% | 0,07%  | -0,04% | -0,05% |

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

|                                 | 1 anno | 3 anni | Data di lancio * |
|---------------------------------|--------|--------|------------------|
| <b>Volatilità</b>               | 11,13% | 15,13% | 17,07%           |
| <b>Volatilità dei benchmark</b> | 11,13% | 15,14% | 17,08%           |
| <b>Tracking Error ex-post</b>   | 0,05%  | 0,04%  | 0,04%            |
| <b>Sharpe Ratio</b>             | 2,40   | 0,78   | 0,87             |

\* 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

\* 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.

Dati dell'indice (Fonte : Amundi)

Descrizione

L'indice è un indice azionario basato sull'indice MSCI USA (il "Parent Index"), rappresentativo dei titoli di grandi e medie dimensioni del mercato statunitense ed emesso da società che hanno il più alto rating ambientale, sociale e di governance (ESG) in ogni settore dell'indice Parent.

Caratteristiche (Fonte : Amundi)

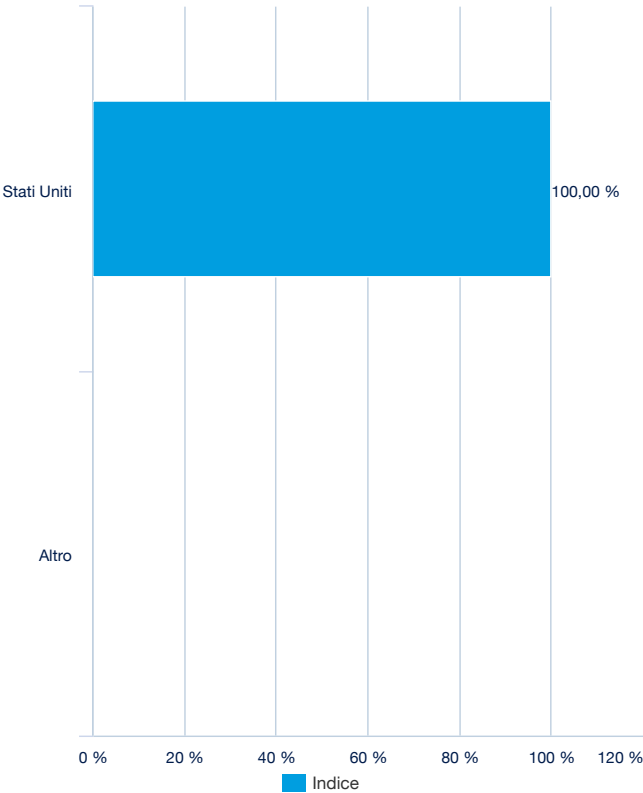
Classe di investimento : **Azionario**  
Esposizione : **USA**  
Valuta di riferimento dell'indice : **USD**  
Numero di titoli : **292**

Primi dieci titoli dell'indice (Fonte : Amundi)

|                         | % del peso<br>sul Benchmark | % di attivi (Indice tradizionale) |
|-------------------------|-----------------------------|-----------------------------------|
| NVIDIA CORP             | 5,94%                       | -                                 |
| MICROSOFT CORP          | 4,97%                       | -                                 |
| ELI LILLY & CO          | 3,08%                       | -                                 |
| ALPHABET INC CL A       | 2,73%                       | -                                 |
| TESLA INC               | 2,47%                       | -                                 |
| ALPHABET INC CL C       | 2,40%                       | -                                 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 2,17%                       | -                                 |
| MASTERCARD INC-CL A     | 1,98%                       | -                                 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 1,88%                       | -                                 |
| HOME DEPOT INC          | 1,87%                       | -                                 |
| <b>Totale</b>           | <b>29,47%</b>               | <b>-</b>                          |

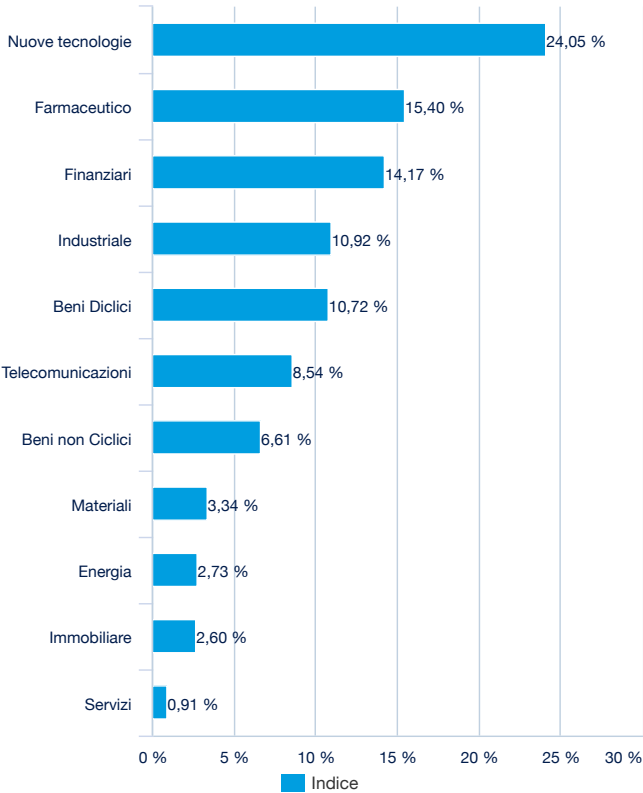
Indice tradizionale :

Ripartizione geografica (Fonte : Amundi)



Indice tradizionale :

Ripartizione settoriale (Fonte : Amundi)



Indice tradizionale :

**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 | PTF  | Criteri ESG                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----------------------|--------|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Rating Globale</b> | 7,51   | 7,69 | I criteri sono criteri extra-finanziari utilizzati per valutare le pratiche ambientali, sociali e di governance delle imprese.                                                                                                              |
| <b>Environment</b>    | 7,20   | 6,84 | 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. |
| <b>Sociale</b>        | 5,53   | 5,97 |                                                                                                                                                                                                                                             |
| <b>Governance</b>     | 5,81   | 6,14 |                                                                                                                                                                                                                                             |
| Indice tradizionale : |        |      | I punteggi si collocano su una scala compresa tra 0 e 10 (10 è il punteggio migliore).                                                                                                                                                      |
|                       |        |      | <b>“E” per Environment</b> (mutamenti climatici, risorse naturali, inquinamento e rifiuti, opportunità ambientali)                                                                                                                          |
|                       |        |      | <b>“S” per Social</b> (risorse umane, affidabilità dei prodotti, opposizione degli stakeholder e opportunità sociali)                                                                                                                       |
|                       |        |      | <b>“G” per Governance</b> (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 tradizionale | PTF    |
|-----------------------------------------------------------------------------|---------------------|--------|
| Intensità di carbonio totale del portafoglio (Indice/Indice tradizionale) : | -                   | 193,87 |

**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 CO<sub>2</sub> (tCO<sub>2</sub>e) 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 CO<sub>2</sub> 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 CO<sub>2</sub> equivalente.

**Etichetta SRI**

**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                              | 18/04/2018                        |
| Prima data di NAV                           | 04/12/2008                        |
| Valuta di riferimento della classe          | EUR                               |
| Classificazione                             | -                                 |
| Tipologia dei dividendi                     | Az. ad Accumulazione              |
| Codice ISIN                                 | LU1681042864                      |
| Minimo di sottoscrizione mercato secondario | 1 Azione/quota                    |
| Frequenza di calcolo della quota            | Giornaliera                       |
| Spese correnti                              | 0,35% ( Stimati ) - 29/09/2023    |
| 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    | CU2    | CU2 IM           | INCU2INAV.MI   | CU2.MI      | .INCU2       |
| Deutsche Börse      | 9:00 - 17:30 | EUR    | ACU2   | ACU2 GY          | INCU2          | ACU2.DE     | INCU2INAV.PA |
| Nyse Euronext Paris | 9:05 - 17:35 | EUR    | CU2    | CU2 FP           | INCU2INAV.PA   | CU2.PA      | .INCU2       |

**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<br>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

AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS (THE "SUB-FUND") IS NOT SPONSORED, ENDORSED, SOLD OR PROMOTED BY MSCI INC. ("MSCI"), ANY OF ITS AFFILIATES, ANY OF ITS INFORMATION PROVIDERS OR ANY THIRD PARTY INVOLVED IN, OR RELATED TO, COMPILING OR CREATING ANY MSCI INDEX (COLLECTIVELY, THE "MSCI PARTIES"). THE MSCI INDICES ARE THE EXCLUSIVE PROPERTY OF MSCI AND ARE SERVICE MARKS OF MSCI OR ITS AFFILIATES. THE MSCI INDICES HAVE BEEN LICENSED FOR USE FOR CERTAIN PURPOSES BY AMUNDI. NONE OF THE MSCI PARTIES MAKES ANY REPRESENTATION OR WARRANTY, EXPRESS OR IMPLIED, TO THE ISSUER OR OWNERS OF THIS SUB-FUND OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY REGARDING THE ADVISABILITY OF INVESTING IN SUB-FUNDS GENERALLY OR IN THIS PARTICULAR SUB-FUND OR THE ABILITY OF ANY MSCI INDEX TO TRACK CORRESPONDING STOCK MARKET PERFORMANCE. MSCI OR ITS AFFILIATES ARE THE LICENSORS OF CERTAIN TRADEMARKS, SERVICE MARKS AND TRADE NAMES AND OF THE MSCI INDICES WHICH ARE DETERMINED, COMPOSED AND CALCULATED BY MSCI WITHOUT REGARD TO AMUNDI OR THIS SUB-FUND OR THIS SUB-FUND'S UNITHOLDERS OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY.

NONE OF THE MSCI PARTIES HAS ANY OBLIGATION TO TAKE THE NEEDS OF THE AMUNDI, THIS SUB-FUND'S UNITHOLDERS OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY INTO CONSIDERATION IN DETERMINING, COMPOSING OR CALCULATING THE MSCI INDICES. NONE OF THE MSCI PARTIES IS RESPONSIBLE FOR OR HAS PARTICIPATED IN DETERMINATION OF THE TIMING OF, PRICES AT, OR QUANTITIES OF THIS SUB-FUND TO BE ISSUED OR IN THE DETERMINATION OR CALCULATION OF THE EQUATION BY OR THE CONSIDERATION INTO WHICH THIS SUB-FUND IS REDEEMABLE. FURTHERMORE, NONE OF THE MSCI PARTIES HAS ANY OBLIGATION OR LIABILITY TO THE ISSUER OR OWNERS OF THIS SUB-FUND OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY IN CONNECTION WITH THE ADMINISTRATION, MARKETING OR OFFERING OF THIS SUB-FUND.

ALTHOUGH MSCI SHALL OBTAIN INFORMATION FOR INCLUSION IN OR FOR USE IN THE CALCULATION OF THE MSCI INDICES FROM SOURCES THAT MSCI CONSIDERS RELIABLE, NONE OF THE MSCI PARTIES WARRANTS OR GUARANTEES THE ORIGINALITY, ACCURACY AND/OR THE COMPLETENESS OF ANY MSCI INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. NONE OF THE MSCI PARTIES MAKES ANY WARRANTY, EXPRESS OR IMPLIED, AS TO RESULTS TO BE OBTAINED BY THE ISSUER OF THE SUB-FUND, OWNERS OF THE SUB-FUND, OR ANY OTHER PERSON OR ENTITY, FROM THE USE OF ANY MSCI INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. NONE OF THE MSCI PARTIES SHALL HAVE ANY LIABILITY FOR ANY ERRORS, OMISSIONS OR INTERRUPTIONS OF OR IN CONNECTION WITH ANY MSCI INDEX OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. FURTHERMORE, NONE OF THE MSCI PARTIES MAKES ANY EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES OF ANY KIND, AND THE MSCI PARTIES HEREBY EXPRESSLY DISCLAIM ALL WARRANTIES OF MERCHANTABILITY AND FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE, WITH RESPECT TO EACH MSCI INDEX AND ANY DATA INCLUDED THEREIN. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING, IN NO EVENT SHALL ANY OF THE MSCI PARTIES HAVE ANY LIABILITY FOR ANY DIRECT, INDIRECT, SPECIAL, PUNITIVE, CONSEQUENTIAL OR ANY OTHER DAMAGES (INCLUDING LOST PROFITS) EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES.

## 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 costituiscano 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.

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.