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

REPORT MENSILE

31/03/2024

Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : **601,54 (EUR)**
Data di valorizzazione : **28/03/2024**
Patrimonio in gestione : **37,16 (milioni EUR)**
Codice ISIN : **LU1602145119**
Tipo di replica : **Fisico**
Benchmark :
100% SCIENTIFIC BETA DEVELOPED MULTI-BETA MULTI-STRATEGY ERC

Obiettivo di investimento

L'obiettivo è replicare il più fedelmente possibile il rendimento dell'indice di strategia Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy ERC ('l'Indice di strategia'), a prescindere dal relativo andamento positivo o negativo. . Il Comparto mira a conseguire un livello di tracking error proprio e di quello del suo indice normalmente non superiore all'1%.

Indicatore di rischio *(Fonte : Fund Admin)*

1 2 3 **4** 5 6 7

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 *
Volatilità	9,09%	12,01%	16,08%
Volatilità dei benchmark	9,06%	12,00%	16,08%
Tracking Error ex-post	0,13%	0,11%	0,13%
Sharpe Ratio	1,57	0,56	0,50

* 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)

	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	14/02/2018
Portafoglio	9,28%	4,12%	9,28%	17,94%	27,19%	51,41%	66,65%
Benchmark	9,44%	4,17%	9,44%	18,35%	28,43%	53,70%	69,55%
Scostamento	-0,17%	-0,05%	-0,17%	-0,42%	-1,24%	-2,29%	-2,90%

Performance annuale* (Fonte : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portafoglio	9,70%	-9,10%	28,15%	-2,51%	27,61%
Benchmark	9,98%	-8,79%	28,48%	-2,23%	27,95%
Scostamento	-0,29%	-0,31%	-0,33%	-0,27%	-0,33%

** 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.*

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

REPORT MENSILE 31/03/2024

Dati dell'indice (Fonte : Amundi)

Descrizione

L'Indice di strategia, dividendi netti reinvestiti (i dividendi al netto di imposizioni fiscali versati dalle azioni che compongono l'Indice sono integrati nel calcolo dell'indice), denominato in euro, è calcolato e pubblicato dal fornitore di indici ERI Scientific Beta.L'Indice di strategia è composto da azioni emesse da società a media e grande capitalizzazione dei Paesi sviluppati.L'obiettivo dell'Indice di strategia è generare un rendimento superiore a quello dell'indice che riguardi lo stesso universo d'investimento, ma ponderato dalla capitalizzazione di borsa, replicando la performance di 4 sottoindici selezionati e ponderati tra gli indici "Scientific Beta" ideati da ERIA su quest'universo azionario delle medie e grandi capitalizzazioni dei mercati sviluppati.

Caratteristiche (Fonte : Amundi)

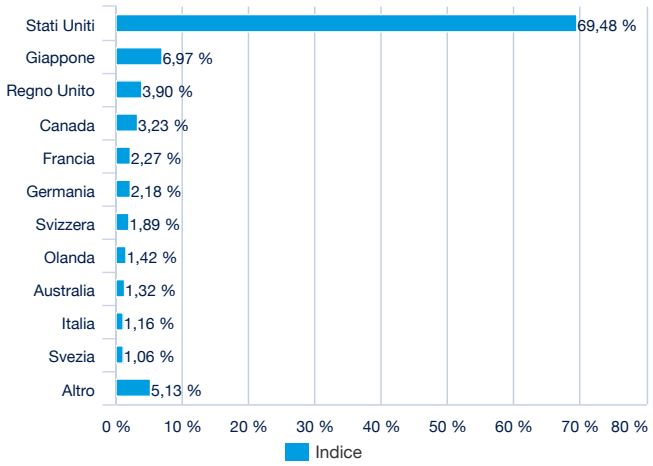
Classe di investimento : **Azionario**
Esposizione : **Internazionale**

Numero di titoli : **1118**

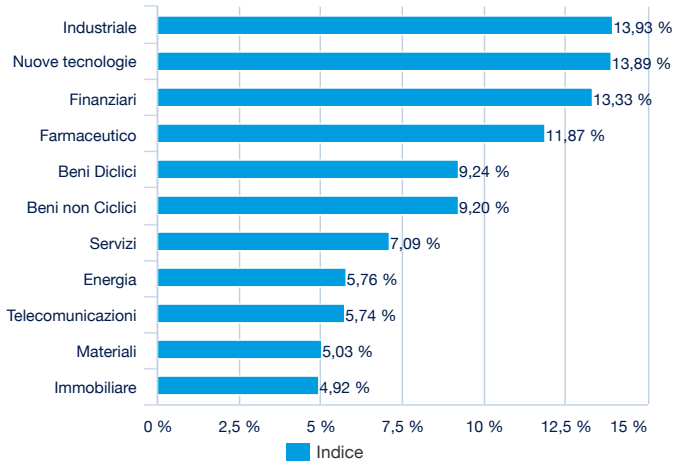
Primi dieci titoli dell'indice (Fonte : Amundi)

	% del peso sul Benchmark
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%
Totale	**5,30%**

Ripartizione geografica (Fonte : Amundi)



Ripartizione settoriale (Fonte : Amundi)



Dati di negoziazione dell'ETF (Fonte : Amundi)

Piazza	Orario	Valuta	Codice	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	SM8T	SM8T GY	ISMRT	SM8T.DE	ISMRTINAV.PA
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	SMRT	SMRT IM	ISMRT	SMRTA.MI	ISMRTINAV
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	EUR	SMRT	SMRT FP	ISMRT	SMRTA.PA	ISMRTINAV.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
Svizzeria (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

Amundi ASSET MANAGEMENT | ETF

Amundi Asset Management, SAS (French : Société par Actions Simplifiée) con capitale di 1 143 615 555 €
Società di gestione del portafoglio approvata dell'AMF N° GP 04000036
Sede legale: 91-93, boulevard Pasteur – 75015 Parigi – Francia 437 574 452 RCS Parigi
Questo documento è esclusivamente destinato agli investitori « professionali »

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

REPORT MENSILE 31/03/2024

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	20/04/2017
Prima data di NAV	14/02/2018
Valuta di riferimento della classe	EUR
Classificazione	-
Tipologia dei dividendi	Az. ad Accumulazione
Codice ISIN	LU1602145119
Minimo di sottoscrizione mercato secondario	1 Azione/quota
Frequenza di calcolo della quota	Giornaliera
Spese correnti	0,40% (prelevati) - 08/02/2023
Orizzonte d'investimento minimo consigliato	5 anni
Chiusura fiscale	Dicembre
Market Maker ufficiale	BNP Paribas

Dati Indici

Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC (L'"INDICE DI STRATEGIA") CUI SI FA RIFERIMENTO QUI È PROPRIETÀ DI EDHEC RISK INSTITUTE ASIA LTD ("ERIA") ED È STATO CONCESSO IN LICENZA PER L'USO IN CONNESSIONE CON AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA NELL'AMBITO DELL'ATTIVITÀ DI ERI SCIENTIFIC BETA. L'INDICE DI STRATEGIA È CALCOLATO DA ERI SCIENTIFIC BETA SULLA BASE DELLA METODOLOGIA DELL'ISTITUTO EDHEC-RISK.
OGNI PARTE RICONOSCE E ACCETTA CHE AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA NON È SPONSORIZZATO O AVALLATO DA ERIA. ERIA NON RILASCIA ALCUNA DICHIARAZIONE, ESPRESSA O IMPLICITA, E DECLINA ESPRESSAMENTE TUTTE LE GARANZIE (IVI INCLUSE, A TITOLO MERAMENTE ESEMPLIFICATIVO, QUELLE DI COMMERCIABILITÀ E IDONEITÀ PER UNO SCOPO O UTILIZZO SPECIFICO) IN RELAZIONE ALL'INDICE DI STRATEGIA O A QUALSIVOGLIA DATO IVI CONTENUTO O AD ESSO CORRELATO, E IN MODO PARTICOLARE DECLINA QUALSIVOGLIA GARANZIA IN MERITO ALLA QUALITÀ, ALL'ACCURATEZZA E/O ALLA COMPLETEZZA DELL'INDICE DI STRATEGIA O DI QUALSIVOGLIA DATO IN ESSO CONTENUTO, AI RISULTATI OTTENUTI TRAMITE L'USO DELL'INDICE DI STRATEGIA E/O ALLA COMPOSIZIONE DELL'INDICE DI STRATEGIA IN QUALSIASI DETERMINATO MOMENTO O IN QUALSIASI DATA SPECIFICA O IN ALTRO MODO E/O AL MERITO CREDITIZIO DI QUALSIVOGLIA ENTITÀ, O ALLA PROBABILITÀ CHE SI VERIFICHI UN EVENTO CREDITIZIO O UN EVENTO SIMILE (IN QUALSIASI MODO DEFINITO) IN RELAZIONE A QUALSIVOGLIA OBBLIGO NELL'INDICE DI STRATEGIA IN QUALSIASI DETERMINATO MOMENTO O A QUALSIASI DATA SPECIFICA O IN ALTRO MODO. ERIA NON SARÀ RESPONSABILE (PER NEGLIGENZA O IN ALTRO MODO) NEI CONFRONTI DELLE PARTI O DI QUALSIASI ALTRO SOGGETTO DI EVENTUALI ERRORI NELL'INDICE DI STRATEGIA ED ERIA NON È SOGGETTA AD ALCUN OBBLIGO DI INFORMARE LE PARTI O QUALSIVOGLIA SOGGETTO DI EVENTUALI ERRORI IN ESSO PRESENTI. ERIA NON RILASCIA ALCUNA DICHIARAZIONE DI ALCUN TIPO, ESPRESSA O IMPLICITA, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI ACQUISTARE O VENDERE AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA, IN MERITO ALLA CAPACITÀ DELL'INDICE DI STRATEGIA DI REPLICARE LE PERFORMANCE DEL RELATIVO MERCATO, O IN ALTRO MODO CORRELATA ALL'INDICE DI STRATEGIA O A QUALSIVOGLIA OPERAZIONE O PRODOTTO AD ESSO CORRELATI, O IN MERITO ALL'ASSUNZIONE DI QUALSIASI RISCHIO CORRELATO. ERIA NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE IN CONSIDERAZIONE LE NECESSITÀ DI ALCUNA PARTE NEL DETERMINARE, COMPORRE O CALCOLARE L'INDICE DI STRATEGIA. NESSUNA PARTE ACQUIRENTE O VENDITRICE DI AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA O ERIA SI ASSUMONO ALCUNA RESPONSABILITÀ NEI CONFRONTI DI QUALSIASI PARTE DI QUALSIVOGLIA AZIONE O MANCATA AZIONE DA PARTE DI ERIA IN RELAZIONE ALLA DETERMINAZIONE, ALLA RETTIFICA, AL CALCOLO O AL MANTENIMENTO DELL'INDICE DI STRATEGIA.

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 documenti ("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.

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.