

# AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB - UCITS ETF DR - HEDGED USD

REPORT  
MENSILE

31/03/2024

## Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : 204,96 ( USD )  
Data di valorizzazione : 28/03/2024  
Patrimonio in gestione : 743,81 ( milioni USD )  
Codice ISIN : LU1646359882  
Tipo di replica : Fisico  
Benchmark :  
100% MSCI JAPAN SRI FILTERED PAB 100%  
HEDGED TO USD

## Obiettivo di investimento

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB UCITS ETF DR ha l'obiettivo di replicare, nel modo più accurato possibile, la performance dell'indice MSCI Japan SRI Filtered PAB (Total return) con copertura mensile del rischio di cambio in EUR. L'ETF dà esposizione - in un'unica transazione - alle aziende del mercato giapponese di media e grande capitalizzazione, utilizzando un approccio "best-in-class" che seleziona solo le società dotate dei rating MSCI ESG più alti. Vengono inoltre applicati criteri di esclusione su emittenti coinvolti in energia e armi nucleari, tabacco, alcolici, carbone termico, gioco d'azzardo, armi, armi da fuoco ad uso civile, armi controverse, OGM, intrattenimento per adulti, petrolio e gas e produzione e riserve di combustibili fossili, e il peso massimo di ogni componente è limitato al 5%. Inoltre, a proposito di transizione climatica, il fondo soddisfa i requisiti minimi della regolamentazione sui benchmark Paris-aligned dell'Unione Europea (EU PAB).

Per maggiori informazioni si prega di fare riferimento al KIID, al prospetto del fondo e alla metodologia dell'indice di MSCI per una descrizione più dettagliata dei criteri di esclusione.

## 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)



### 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	-	-	18/11/2022
<b>Portafoglio</b>	9,21%	1,11%	9,21%	26,42%	-	-	29,28%
<b>Benchmark</b>	9,34%	1,22%	9,34%	27,08%	-	-	30,01%
<b>Scostamento</b>	-0,12%	-0,11%	-0,12%	-0,66%	-	-	-0,73%

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

	2023	2022	2021	2020	2019
<b>Portafoglio</b>	24,82%	-	-	-	-
<b>Benchmark</b>	25,38%	-	-	-	-
<b>Scostamento</b>	-0,56%	-	-	-	-

\* 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.

## Indicatori di rischio (Fonte : Fund Admin)

	1 anno	3 anni	Data di lancio *
<b>Volatilità</b>	14,02%	-	13,52%
<b>Volatilità dei benchmark</b>	14,05%	-	13,55%
<b>Tracking Error ex-post</b>	0,41%	-	0,38%
<b>Sharpe Ratio</b>	1,49	-	1,14

\* 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

**Dati dell'indice (Fonte : Amundi)**

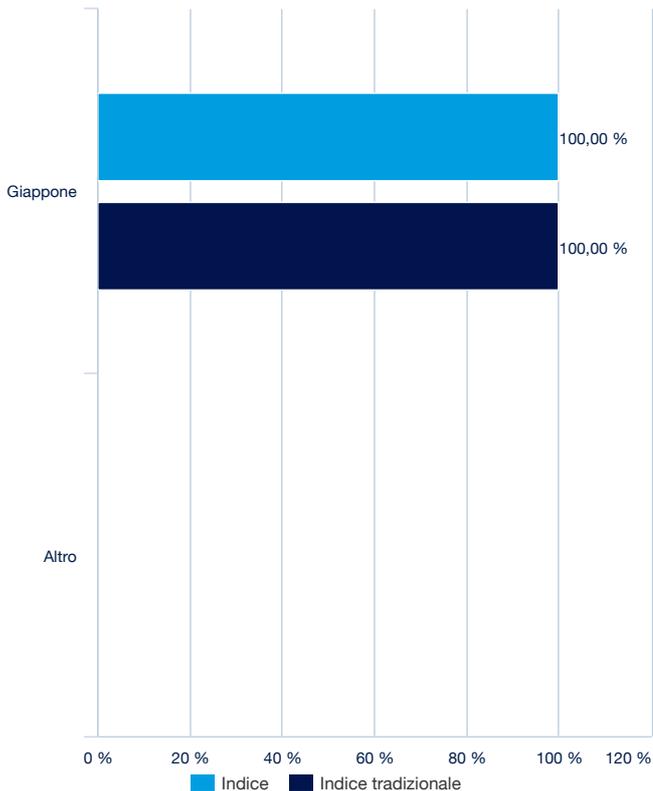
**Descrizione**

MSCI Japan SRI Filtered PAB è un indice azionario basato sull'indice MSCI Japan, rappresentativo delle azioni a capitalizzazione medio-alta del mercato giapponese ("Indice principale"). L'indice fornisce esposizione a società con eccellenti valutazioni ambientali, sociali e di governance (ESG) ed esclude le società i cui prodotti hanno un impatto sociale o ambientale negativo. Inoltre, l'indice mira a rappresentare il rendimento di una strategia che prevede la ri-ponderazione dei titoli in base alle opportunità e ai rischi associati alla transizione climatica per soddisfare i requisiti minimi del regolamento EU Paris-Aligned Benchmark (EU PAB).

**Caratteristiche (Fonte : Amundi)**

Classe di investimento : **Azionario**  
Esposizione : **Giappone**  
Valuta di riferimento dell'indice : **JPY**  
Numero di titoli : **47**

**Ripartizione geografica (Fonte : Amundi)**



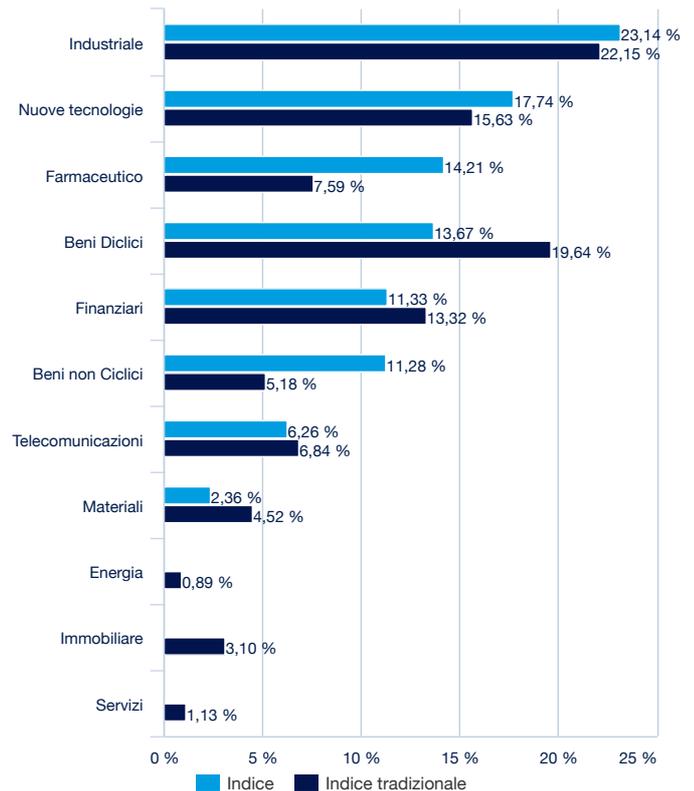
Indice tradizionale : **MSCI JAPAN**

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

	% del peso sul Benchmark	% di attivi (Indice tradizionale)
HOYA CORP	5,08%	1,09%
SONY GROUP CORP (JT)	4,78%	2,72%
SUMITOMO MISUI FINAN	4,62%	1,88%
ADVANTEST	4,48%	0,87%
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	4,48%	1,41%
FANUC CORP	4,34%	0,66%
DAIKIN INDUSTRIES LTD	4,00%	0,90%
ORIENTAL LAND CO LTD	3,49%	0,88%
RENASAS ELECTRONICS CORP	3,47%	0,65%
KDDI CORP	3,45%	1,11%
<b>Totale</b>	<b>42,19%</b>	<b>12,16%</b>

Indice tradizionale : **MSCI JAPAN**

**Ripartizione settoriale (Fonte : Amundi)**



Indice tradizionale : **MSCI JAPAN**

## 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>	8,79	7,32
<b>Environment</b>	6,94	6,14
<b>Sociale</b>	6,13	5,53
<b>Governance</b>	6,07	5,60

Indice tradizionale : **MSCI JAPAN**

### 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)

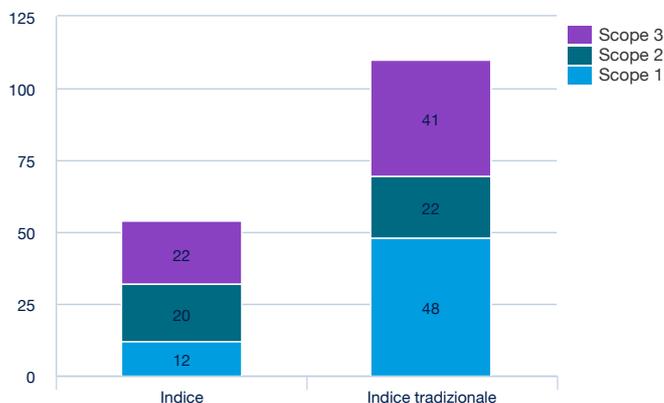
**“G” per Governance** (governance e comportamento d'impresa)

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) :	53,96	110,37



Indice tradizionale : **MSCI JAPAN**

### 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 può 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



REPUBLIQUE FRANÇAISE

**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	18/11/2022
Prima data di NAV	18/11/2022
Valuta di riferimento della classe	USD
Classificazione	-
Tipologia dei dividendi	Az. ad Accumulazione
Codice ISIN	LU1646359882
Minimo di sottoscrizione mercato secondario	1 Azione/quota
Frequenza di calcolo della quota	Giornaliera
Spese correnti	0,20% ( Stimati ) - 31/10/2022
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
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	USD	JPXU	JPXU LN	JPXUIV	JPXU.L	JPXUINAV=SOLA

**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**

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB (IL "COMPARTO") NON È SPONSORIZZATO, AVALLATO, VENDUTO NÉ PROMOSSO DA MSCI INC. ("MSCI"), DALLE SUE AFFILIATE, DAI SUOI FORNITORI DI INFORMAZIONI O DA TERZE PARTI COINVOLTE NELLA, CORRELATE ALLA O RESPONSABILI DELLA COMPILAZIONE O CREAZIONE DI UN INDICE MSCI (CONGIUNTAMENTE, LE "PARTI MSCI"). GLI INDICI MSCI SONO DI PROPRIETÀ ESCLUSIVA DI MSCI E SONO MARCHI DI SERVIZIO DI MSCI O DELLE SUE AFFILIATE. GLI INDICI MSCI SONO STATI CONCESSI IN LICENZA D'USO AD AMUNDI PER SCOPI SPECIFICI. LE PARTI MSCI DECLINANO QUALSIVOGLIA RESPONSABILITÀ O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, NEI CONFRONTI DELL'EMITTENTE O DEI TITOLARI DEL PRESENTE COMPARTO O DI ALTRI SOGGETTI O ENTITÀ, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE NEI COMPARTI IN GENERALE O NEL PRESENTE COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DI QUALSIVOGLIA INDICE MSCI DI REPLICARE IL RENDIMENTO DEL MERCATO AZIONARIO CORRISPONDENTE. MSCI O LE SUE AFFILIATE SONO I CONCESSORI DI LICENZA DI DETERMINATI MARCHI COMMERCIALI, MARCHI DI SERVIZIO E NOMI COMMERCIALI E DEGLI INDICI MSCI, CHE SONO STABILITI, COMPOSTI E CALCOLATI DA MSCI IN MODO INDIPENDENTE DA AMUNDI, DAL PRESENTE COMPARTO, DAI TITOLARI DI QUOTE DEL PRESENTE COMPARTO O DA ALTRI SOGGETTI O ENTITÀ.

NESSUNA DELLE PARTI MSCI HA L'OBBLIGO DI PRENDERE IN CONSIDERAZIONE LE ESIGENZE DI AMUNDI, DEI DETENTORI DI QUOTE DEL PRESENTE COMPARTO O DI QUALSIASI ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA PER DETERMINARE, COMPORRE O CALCOLARE GLI INDICI MSCI. NESSUNA DELLE PARTI MSCI È RESPONSABILE O HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI TEMPI, DEI PREZZI O DELLE QUANTITÀ DA EMETTERE DI QUESTO COMPARTO, O ALLA DETERMINAZIONE O AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE O DEL CORRISPETTIVO IN CUI TALE COMPARTO È RIMBORSABILE. INOLTRE, NESSUNA DELLE PARTI MSCI HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ NEI CONFRONTI DELL'EMITTENTE O DEI PROPRIETARI DEL PRESENTE COMPARTO O DI QUALSIASI ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALL'OFFERTA DEL PRESENTE COMPARTO.

SEBBENE MSCI OTTenga INFORMAZIONI PER L'INCLUSIONE O PER L'USO NEL CALCOLO DEGLI INDICI MSCI DA FONTI CHE RITIENE AFFIDABILI, NESSUNA DELLE PARTI MSCI GARANTISCE O DICHIARA L'ORIGINALITÀ, L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DI QUALSIASI INDICE MSCI O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. NESSUNA DELLE PARTI MSCI FORNISCE QUALSIASI DICHIARAZIONE, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI OTTENIBILI DALL'EMITTENTE DEL COMPARTO, DAI TITOLARI DEL COMPARTO O DA ALTRI SOGGETTI O ENTITÀ MEDIANTE L'UTILIZZO DELL'INDICE O DEI DATI IVI INCLUSI. NESSUNA DELLE PARTI MSCI AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER EVENTUALI ERRORI, OMISSIONI O INTERRUZIONI DI O IN RELAZIONE A QUALSIASI INDICE MSCI O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. INOLTRE, NESSUNA DELLE PARTI MSCI FORNISCE ALCUNA GARANZIA ESPLICITA O IMPLICITA DI ALCUN TIPO E LE PARTI MSCI DECLINANO ESPRESSAMENTE OGNI GARANZIA DI COMMERCIALITÀ E IDONEITÀ PER UNO SCOPO PARTICOLARE, RISPETTO A CIASCUN INDICE MSCI E AI DATI IVI INCLUSI. SENZA LIMITARE QUANTO SOPRA, NESSUNA DELLE PARTI MSCI AVRÀ MAI ALCUNA RESPONSABILITÀ PER QUALSIASI DANNO DIRETTO, INDIRETTO, SPECIALE, PUNITIVO, CONSEGUENZIALE O QUALSIASI ALTRO DANNO (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) ANCHE SE INFORMATO DELLA POSSIBILITÀ DI INCORRERE IN TALI DANNI.

**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.

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.