

AMUNDI INDEX US CORP SRI - IE

FACTSHEET

Marketing-
Anzeige

31/12/2024

ANLEIHEN ■

Wesentliche Informationen (Quelle : Amundi)

Nettoinventarwert (NAV) : 1.293,33 (EUR)
 Datum des NAV : 31/12/2024
 Fondsvolumen : 1.224,66 (Millionen EUR)
 ISIN-Code : LU1806494255
 Bloomberg-Code : AMICSIC LX
 Referenzindex :
100% BLOOMBERG MSCI US CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI

Anlageziel

Das Ziel dieses Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index (der „Index“) nachzubilden und den Tracking Error zwischen dem Nettoinventarwert des Teilfonds und der Wertentwicklung des Index zu minimieren.
 Der Teilfonds strebt an, ein Tracking-Error-Niveau zwischen dem Teilfonds und seinem Index zu erreichen, das in der Regel nicht mehr als 1 % beträgt.

Risiko-indikator (Quelle: Fund Admin)



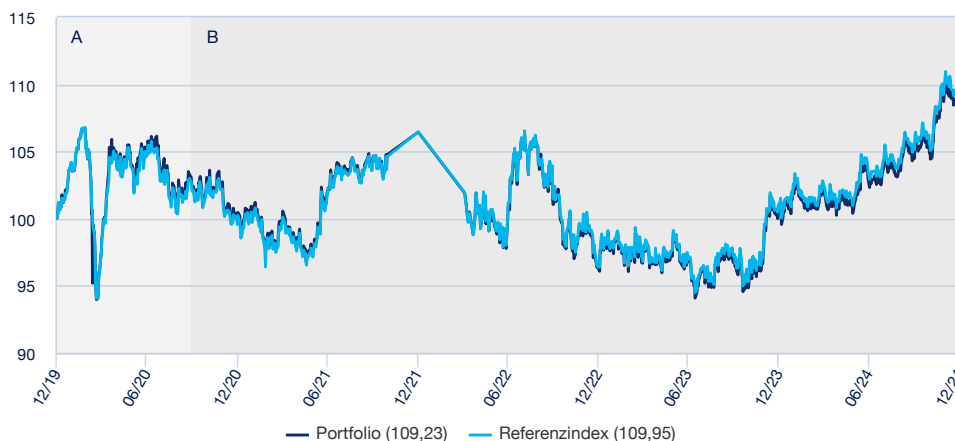
⚡ Niedrigeres Risiko

⚡ Höheres Risiko

⚠ Der Risiko-Indikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt für 4 Jahre lang halten.
 Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubehalten.

Wertentwicklung (Quelle: Fondsadministrator) - Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.

Performanceentwicklung (Basis: 100) * von 31/12/2019 bis 31/12/2024 (Quelle: Fund Admin)



A : Bis zum Ende dieses Zeitraums, war der Referenzindikator des Teilfonds der Bloomberg Barclays MSCI US Corporate SRI
 B : Seit Beginn dieses Zeitraums ist der Referenzindikator des Teilfonds Barclays MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI

Kumulierte Wertentwicklung* (Quelle: Fondsadministrator)

seit dem	seit dem	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	seit dem
	29/12/2023	29/11/2024	30/09/2024	29/12/2023	31/12/2021	31/12/2019	20/07/2018
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	8,47%	0,09%	4,55%	8,47%	2,62%	9,23%	30,77%
Referenzindex	8,91%	0,11%	4,58%	8,91%	3,27%	9,95%	31,63%
Abweichung	-0,44%	-0,02%	-0,04%	-0,44%	-0,65%	-0,72%	-0,86%

Kalenderjahr Wertentwicklung* (Quelle: Fund Admin)

	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	8,47%	4,56%	-9,52%	5,95%	0,47%	16,79%	-	-	-	-
Referenzindex	8,91%	4,73%	-9,47%	6,21%	0,24%	16,67%	-	-	-	-
Abweichung	-0,44%	-0,18%	-0,05%	-0,26%	0,23%	0,12%	-	-	-	-

* Quelle : Amundi. Die Entwicklungen in der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf aktuelle und künftige Ergebnisse zu und sind keine Garantie für künftige Erträge. Die eventuellen Gewinne oder Verluste berücksichtigen nicht die gegebenenfalls vom Anleger zu tragenden Kosten, Gebühren und Abgaben, die bei der Emission oder der Rücknahme von Anteilen anfallen (z.B.: Steuern, Vermittlungsgebühren oder sonstige vom Intermediär erhobene Gebühren). Wenn die Performances in einer anderen Währung als dem Euro berechnet werden, können die eventuell entstandenen Gewinne oder Verluste Wechselkursschwankungen unterliegen (d.h. sie können zu- oder abnehmen). Der Spread entspricht der Differenz zwischen der Performance des Portfolios und der des Index.

Risikoindikatoren (Quelle: Fund Admin)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Portfolio Volatilität	5,88%	8,07%	8,62%
Referenzindex Volatilität	5,91%	7,94%	8,49%
Tracking Error ex-post	0,82%	1,82%	1,61%
Sharpe Ratio	0,65	-0,22	0,03
Information Ratio	-0,50	-0,11	-0,08

* Die Volatilität ist ein statistischer Indikator, der die Schwankungen eines Vermögenswerts um seinen Mittelwert misst. Beispielsweise entspricht eine Marktschwankung von +/- 1,5% pro Tag einer Volatilität von 25% pro Jahr.

sharp_ratio_indicator

Indikatoren (Quelle : Fund Admin)

	Portfolio
Modifizierte Duration ¹	6,43
Durchschnittliches Rating ²	BBB+
Renditen	5,32%

¹ Die modifizierte Duration (in Punkten) zeigt die prozentuale Änderung des Preises bei einer Veränderung des Referenzzinssatzes um 1%.

² Basierend auf Anleihen und CDS, jedoch ohne sonstige Derivate

Anzahl der Titel : 5226

ANLEIHEN



Stéphanie Pless
Head of Inflation



Olivier Chatelot
Lead Portfolio Manager



Anne-Marie Mussard
Co-Portfolio Manager

Kommentar des Managements

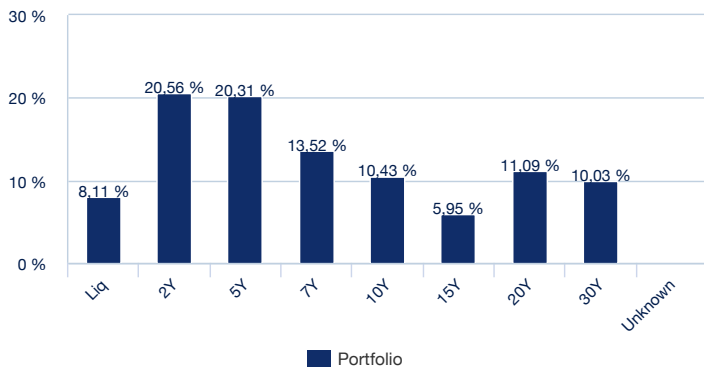
Im Dezember 2024 wurde die Weltwirtschaft maßgeblich durch die Aktionen der Zentralbanken und bemerkenswerte geopolitische Ereignisse geprägt. In den Vereinigten Staaten hat die Federal Reserve ihre dritte aufeinanderfolgende Zinssenkung vorgenommen, indem sie den Leitzins um 25 Basispunkte auf eine Zielspanne von 4,25 % bis 4,5 % gesenkt hat. Diese Entscheidung wurde weitgehend durch eine Mäßigung der Inflation motiviert. Gleichzeitig hat die Europäische Zentralbank am 12. Dezember ihren Leitzins um 25 Basispunkte auf 3,00 % gesenkt, was sie mit einem Rückgang der Inflation auf 2,2 % im November begründete. Diese Anpassungen der Geldpolitik wurden konzipiert, um das Wirtschaftswachstum in einem Kontext abnehmender Inflationsdruck zu fördern. Auf geopolitischer Ebene erlebte Europa politische Unsicherheiten, insbesondere mit dem Sturz der Barnier-Regierung in Frankreich nach einem Misstrauensvotum der Nationalversammlung, was zu einer Ausweitung des OAT-Bund-Spreads führte und somit eine Underperformance der französischen Banken zur Folge hatte. Was den Kreditmarkt betrifft, so waren die Primäremissionen aufgrund der Jahresendfeiertage am Ende des Monats begrenzt; jedoch erreichten die jährlichen Primäremissionen ein historisches Niveau von etwa 630 Milliarden Euro. Ein bedeutender Anteil dieser Emissionen war überzeichnet, was das Marktinteresse an dieser Anlageklasse unterstreicht. Hinsichtlich der Kapitalflüsse in offene Fonds war der Dezember durch positive Zuflüsse in Höhe von 330 Millionen Euro gekennzeichnet, was zu einem Jahresgesamtbetrag von 21 Milliarden Euro beitrug, was 11,6 % des verwalteten Vermögens der Anlageklasse entspricht. Diese Tendenz führte dazu, dass viele das Jahr als "Jahr der Anleihe" bezeichneten. Investoren waren besonders von Unternehmensanleihen angezogen, die höhere Renditen als öffentliche Schulden boten, da Unternehmen bei der Verwaltung ihrer Kreditkosten Widerstandsfähigkeit zeigten. Im Laufe des Monats haben sich die Kreditspreads um 6 Basispunkte verengt und schlossen bei 102 Basispunkten. Allerdings verzeichnete der Markt aufgrund des Anstiegs der Zinssätze eine negative Gesamtrendite von -0,38 %. Hochbeta-Assets übertrafen ihre sichereren Gegenstücke; insbesondere erzielten AT1-Banktitel eine Gesamtrendite von 0,89 %, gefolgt von Hochzinsanleihen mit einer Gesamtrendite von 0,65 % und Hybridanleihen mit 0,61 %. Aus sektoraler Sicht waren die leistungsstärksten Sektoren Lebensversicherungen und Immobilien, während die am wenigsten leistungsstarken Sektoren Banken und die chemische Industrie waren.

Angesichts der laufenden politischen Ereignisse haben wir unsere Exposition gegenüber französischen Banken schrittweise reduziert. Darüber hinaus haben wir eine Übergewichtung im 5-Jahres-Segment der Kreditkurve vorgenommen, während wir eine Normalisierung der Renditekurve durch unsere Strategie der Kurvensteilung erwarten. Dies impliziert eine Übergewichtung des 1-3-Jahres-Segments und eine Untergewichtung der längeren Laufzeiten.

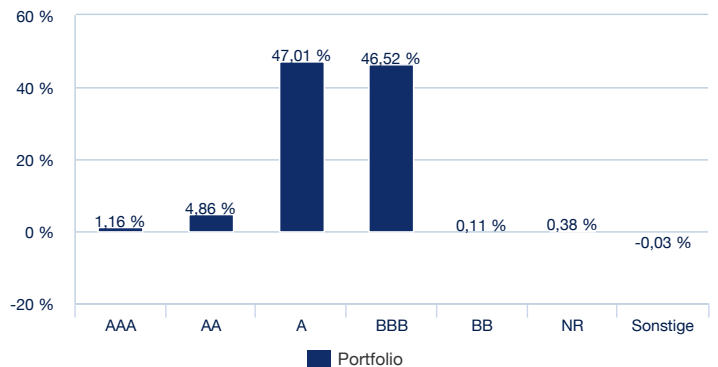
Dieses Portfolio wird indexbezogen im Vergleich zum Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index verwaltet. Wir minimieren die relative Sensibilitätsexposition zwischen dem Portfolio und seinem Index, indem wir in eine begrenzte Anzahl von Titeln investieren, um ein minimales Risiko zu gewährleisten. Leistungsunterschiede zwischen dem Index und dem Portfolio können auf den Swing-Preis zurückzuführen sein.

Aufteilung (Quelle : Amundi)

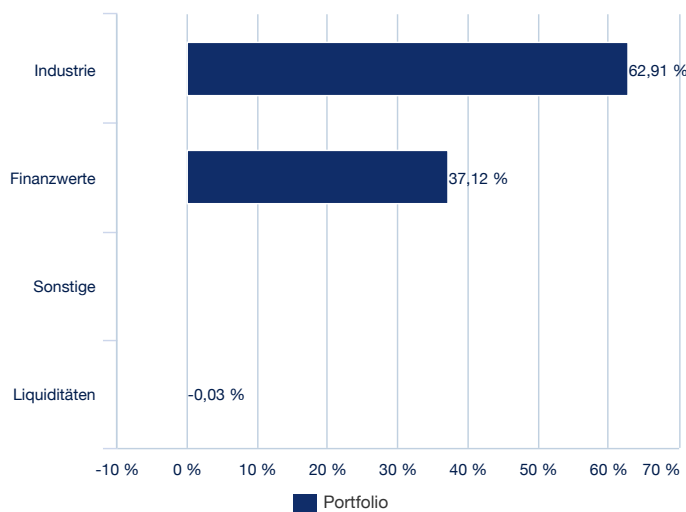
Nach Laufzeit (Quelle : Amundi)



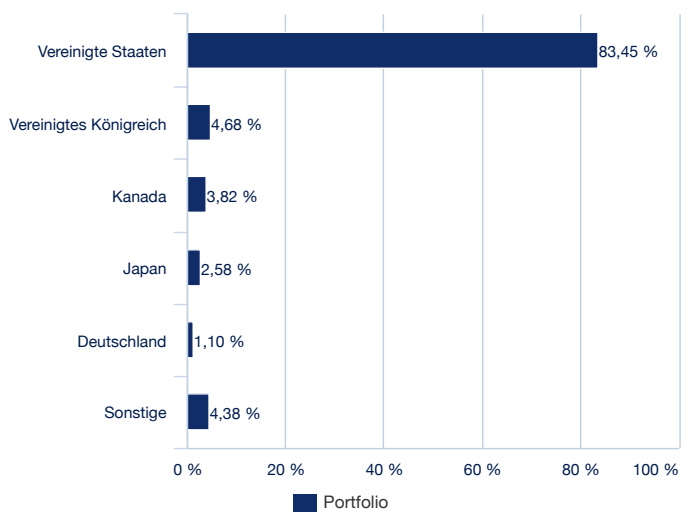
Nach Rating (Quelle : Amundi)



Nach Emittent (Quelle : Amundi)



Nach Ländern (Quelle : Amundi)



ANLEIHEN ■

Hauptmerkmale (Quelle: Amundi)

Rechtsform	OGAW
Anwendbares Recht	nach luxemburgischem Recht
Verwaltungsgesellschaft	Amundi Luxembourg SA
Externes Fondsmanagement	Amundi Asset Management
Depotbank	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Auflagedatum der Anlageklasse	24/04/2018
Referenzwährung der Anteilklasse	EUR
Klassifizierung	Nicht anwendbar
Ertragsverwendung	(C) Thesaurierend (D) Ausschüttend
ISIN-Code	(C) LU1806494255 (D) LU1806494339
Bloomberg-Code	AMICSIC LX
Mindestanlagebetrag bei Erst-/Folgezeichnung	500.000 Equivalent in EUR aus USD / 1 Tausendstel-Anteil(e)/Aktie(n)
Häufigkeit der Berechnung des Nettoinventarwerts	Täglich
Uhrzeit für den Handelsschluss	Anträge pro Tag T vor 14:00
Ausgabeaufschlag (maximal)	2,50%
Erfolgsabhängige Gebühr	Nein
Performancevergütung (% pro Jahr)	-
Rücknahmeabschlag (maximal)	0,00%
Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten	0,15%
Transaktionskosten	0,02%
Umwandlungsgebühr	1,00 %
Empfohlene Mindestanlagedauer	4 Jahre
Übersicht zur Entwicklung des Referenzindex	01/10/2020: 100.00% BLOOMBERG MSCI US CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI 17/04/2018: 100.00% BLOOMBERG MSCI US CORPORATE SRI
OGAW konform	OGAW
Zu aktueller/unbekanntem kurs	Zu unbekanntem kurs
Wertstellungstag Aufkauf	T+2
Wertstellungstag Subskription	T+2
Besonderheit	Nein

Wichtige Hinweise

Dieses Dokument dient nur zu Informationszwecken und stellt keinesfalls eine Anlageberatung, Finanzanalyse oder eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Anteilen oder Aktien der in diesem Dokument präsentierten FCP, FCPE, SICAV, SICAV-Teilfonds oder SPPICAV („die OGA“) dar und darf keinesfalls so ausgelegt werden. Dieses Dokument stellt nicht die Grundlage eines Vertrages oder einer Verpflichtung gleich welcher Art dar. Alle in diesem Dokument enthaltenen Angaben können ohne vorherige Ankündigung geändert werden. Der aktuelle Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“), die Satzung, der Jahres- und der Halbjahresbericht sind kostenlos und in gedruckter Form bei der Zahl- und Informationsstelle (Marcard, Stein & Co AG, Ballindamm 36, D-20095 Hamburg, Deutschland) erhältlich und auf unserer Website www.amundi.com verfügbar. Die Verwaltungsgesellschaft übernimmt keinerlei Haftung, weder direkt noch indirekt, die sich durch die Nutzung sämtlicher in diesem Dokument enthaltenen Angaben ergeben könnte. Die Verwaltungsgesellschaft haftet keinesfalls für Entscheidungen, die auf Grundlage dieser Angaben getroffen werden. Die Angaben in diesem Dokument werden Ihnen auf vertraulicher Basis mitgeteilt und dürfen ohne vorherige schriftliche Zustimmung der Verwaltungsgesellschaft von keinem Dritten und in keinem Land, in dem diese Veröffentlichung oder Nutzung geltenden Rechtsvorschriften zuwiderläuft, oder demzufolge die Verwaltungsgesellschaft oder ihre Fonds verpflichtet wären, sich im besagten Land bei Aufsichtsbehörden registrieren zu lassen, weder kopiert noch vervielfältigt noch geändert noch übersetzt noch veröffentlicht werden. Nicht alle OGA sind unbedingt im jeweiligen Rechtsgebiet sämtlicher Anleger eingetragenen. Anlagen beinhalten Risiken: Die Wertentwicklungen in der Vergangenheit der in diesem Dokument präsentierten OGA sowie die auf Basis dieser Wertentwicklungen durchgeführten Simulationen sind kein verlässlicher Indikator für zukünftige Wertentwicklungen. Sie lassen keine Rückschlüsse auf den künftigen Wertverlauf zu. Der Wert der Anteile oder Aktien der OGA unterliegt den Preisschwankungen auf dem Markt. Daher können die getätigten Anlagen sowohl steigen als auch fallen. Somit können Zeichner der OGA ihr anfänglich investiertes Kapital ganz oder teilweise verlieren. An den OGA interessierte Personen müssen vor jeder Zeichnung sicherstellen, dass die Zeichnung mit den auf sie zutreffenden Gesetzen vereinbar ist, sich der steuerlichen Folgen einer solchen Anlage vergewissern und die geltenden gesetzlich vorgeschriebenen Dokumente jedes OGA zur Kenntnis nehmen. Die Daten dieses Dokuments stammen von der Verwaltungsgesellschaft (sofern nicht anders angegeben). Das Datum der Daten in diesem Dokument ist das oben im Dokument angegebene Datum, sofern nicht anders angegeben.

Dieses Dokument ist ausschließlich für institutionelle, professionelle, qualifizierte oder erfahrene Anleger und Vertriebsstellen bestimmt. Es darf nicht an die breite Öffentlichkeit, Privatkunden oder Einzelanleger in irgendeinem Land und nicht an „US-Personen“ ausgegeben werden. Darüber hinaus sollte ein solcher Anleger in der Europäischen Union ein „professioneller“ Anleger im Sinne der Richtlinie 2004/39/EG vom 21. April 2004 über Märkte für Finanzinstrumente („MIFID“) bzw. im Sinne der jeweiligen lokalen Vorschriften und, im Hinblick auf das Angebot in der Schweiz, ein „qualifizierter Anleger“ im Sinne der Bestimmungen des schweizerischen Gesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG), der schweizerischen Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen vom 22. November 2006 (KKV) und des Rundschreibens 08/8 der FINMA im Sinne der Gesetzgebung über die kollektiven Kapitalanlagen vom 20. November 2008 sein. Das Dokument darf in der Europäischen Union unter keinen Umständen an nicht „professionelle“ Anleger im Sinne der MIFID oder der jeweiligen lokalen Vorschriften oder in der Schweiz an Anleger, auf welche die in den geltenden Gesetzen und Vorschriften enthaltene Definition von „qualifizierten Anlegern“ nicht zutrifft, ausgegeben werden.