

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB - UCITS ETF DR - HEDGED CHF

AZIONARIO ■

REPORT

Comunicazione
di Marketing

31/03/2024

Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : **142,60 (CHF)**
Data di valorizzazione : **28/03/2024**
Patrimonio in gestione : **669,95 (milioni CHF)**
Codice ISIN : **LU1646360039**
Tipo di replica : **Fisico**
Benchmark :
**100% MSCI JAPAN SRI FILTERED PAB 100%
HEDGED TO CHF**

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
Portafoglio	8,37%	0,86%	8,37%	21,84%	-	-	22,75%
Benchmark	8,42%	0,88%	8,42%	21,85%	-	-	22,74%
Scostamento	-0,05%	-0,02%	-0,05%	-0,01%	-	-	0,01%

Performance annuale* (Fonte : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portafoglio	19,95%	-	-	-	-
Benchmark	19,90%	-	-	-	-
Scostamento	0,05%	-	-	-	-

Indicatori di rischio (Fonte : Fund Admin)

	1 anno	3 anni	Data di lancio *
Volatilità	14,07%	-	13,52%
Volatilità dei benchmark	14,07%	-	13,53%
Tracking Error ex-post	0,31%	-	0,29%
Sharpe Ratio	1,53	-	1,17

* 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.

AZIONARIO

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)

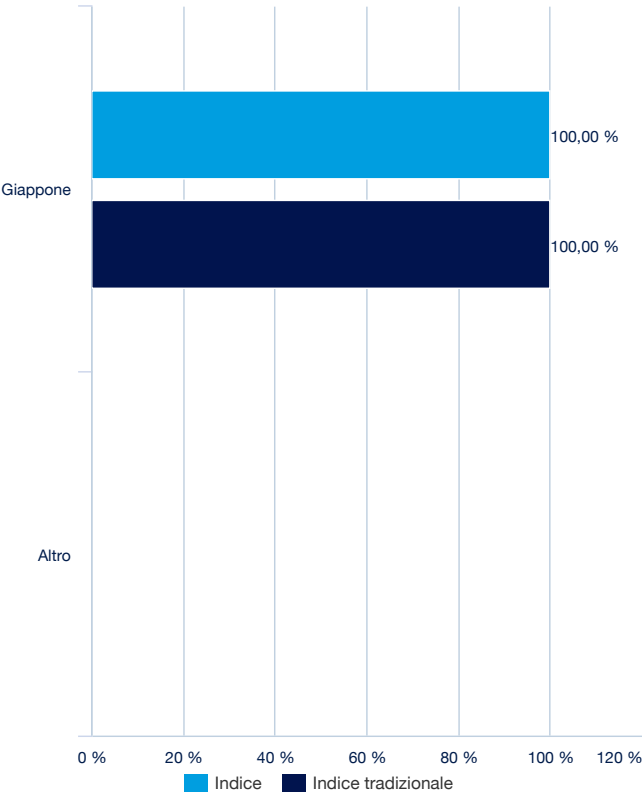
Classe di investimento : **Azionario**
Esposizione : **Giappone**
Valuta di riferimento dell'indice : **JPY**
Numero di titoli : **47**

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%
Totale	42,19%	12,16%

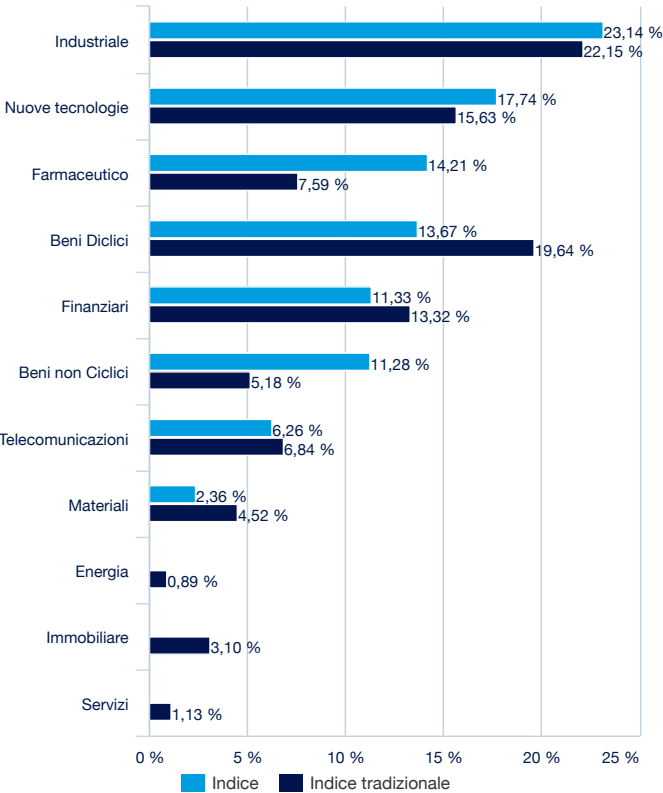
Indice tradizionale : **MSCI JAPAN**

Ripartizione geografica (Fonte : Amundi)



Indice tradizionale : **MSCI JAPAN**

Ripartizione settoriale (Fonte : Amundi)



Indice tradizionale : **MSCI JAPAN**

AZIONARIO ■

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
Rating Globale	8,79	7,32
Environment	6,94	6,14
Sociale	6,13	5,53
Governance	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)

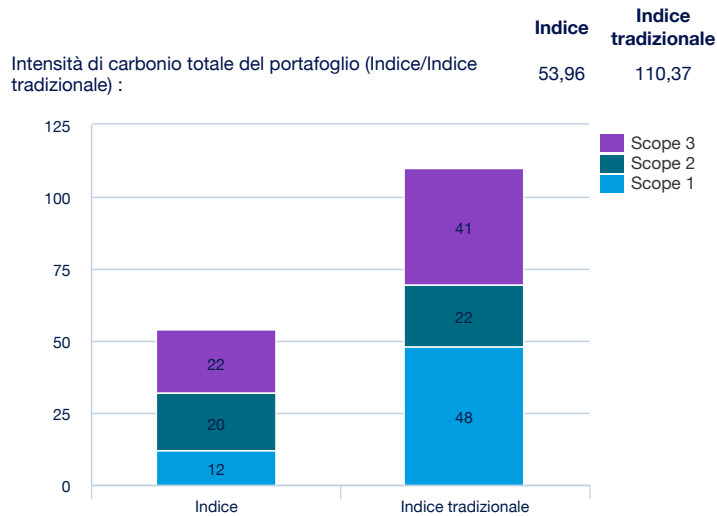
"S" per Social (risorse umane, affidabilità dei prodotti, opposizione degli stakeholder e opportunità sociali)

"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 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 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.

Etichetta SRI



RÉPUBLIQUE FRANÇAISE

AZIONARIO ■

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	CHF
Classificazione	-
Tipologia dei dividendi	Az. ad Accumulazione
Codice ISIN	LU1646360039
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
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	CHF	8R80	8R80 GY	JPXCIV	8R80.DE	JPXCINAV=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

AZIONARIO ■

Dati Indici

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB (IL "COMPARTO") NON È SPONSORIZZATO, AVALLATO, VENDUTO O PROMOSSO DA MSCI INC. ("MSCI"), DA ALCUNA DELLE SUE AFFILIATE, DAI SUOI FORNITORI DI INFORMAZIONI O QUALSIASI PARTE TERZA COINVOLTA O CORRELATA ALLA COMPILAZIONE O ALLA CREAZIONE DI QUALSIVOGLIA INDICE MSCI (COLLETTIVAMENTE, 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 PER L'UTILIZZO PER DETERMINATI FINI DA PARTE DI AMUNDI. NESSUNA DELLE PARTI MSCI RILASCI A DICHIARAZIONI O GARANZIE, ESPLICITE O IMPLICITE, ALL'EMITTENTE O AI TITOLARI DEL PRESENTE COMPARTO O A QUALSIVOGLIA ALTRO SOGGETTO O ENTITÀ RELATIVAMENTE ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE INCOMPARTI IN GENERALE O IN QUESTO COMPARTO IN PARTICOLARE O IN MERITO ALLA CAPACITÀ DI QUALSIVOGLIA INDICE MSCI DI REPLICARE IL RENDIMENTO DEL MERCATO AZIONARIO CORRISPONDENTE. MSCI O LE SUE AFFILIATE SONO TITOLARI DILIGENZA DI TALUNI MARCHI COMMERCIALI, MARCHI DI SERVIZIO E NOMI COMMERCIALI E DEGLI INDICI MSCI CHE VENGONO DETERMINATI, COMPOSTI E CALCOLATI DA MSCI INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DA QUESTO COMPARTO O DAI DETENTORI DI QUOTE DI QUESTO COMPARTO O DA QUALSIVOGLIA ALTRO SOGGETTO O ENTITÀ.

NESSUNA DELLE PARTI MSCI HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE IN CONSIDERAZIONE LE NECESSITÀ DI AMUNDI, DEI DETENETORI DI QUOTE DI QUESTO COMPARTO O DI QUALSIVOGLIA ALTRO SOGGETTO O ENTITÀ NEL DETERMINARE, COMPORRE O CALCOLARE GLI INDICI MSCI. NESSUNA DELLE PARTI MSCI È RESPONSABILE DI, O HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DELLA TEMPSTICA, DEI PREZZI O DELLE QUANTITÀ DA EMETTERE DEL PRESENTE COMPARTO O ALLA DETERMINAZIONE O AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE IN BASE ALLA QUALE O DEL CONTROLLO RISPETTO AL QUALE IL PRESENTE COMPARTO È RIMBORSABILE. INOLTRE, NESSUNA DELLE PARTI MSCI HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ NEI CONFRONTI DELL'EMITTENTE O DEI TITOLARI DEL PRESENTE COMPARTO O DI QUASIVOGLIA ALTRO SOGGETTO O ENTITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALL'OFFERTA DEL PRESENTE COMPARTO.

SEBBENE MSCI OTTENG A INFORMAZIONI PER L'INCLUSIONE O L'USO NEL CALCOLO DEGLI INDICI MSCI DA FONTI CHE MSCI CONSIDERA AFFIDABILI, NESSUNA DELLE PARTI MSCI ASSICURA O GARANTISCE L'ORIGINALITÀ, L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DI QUALSIASI INDICE MSCI O DI QUALSIVOGLIA DATO IVI CONTENUTO. NESSUNA DELLE PARTI MSCI RILASCI ALCUNA GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN RELAZIONE AI RISULTATI OTTENIBILI DALL'EMITTENTE DEL COMPARTO, DAI TITOLARI DEL COMPARTO O DA QUALSIVOGLIA ALTRO SOGGETTO O ENTITÀ, MEDIANTE L'UTILIZZO DI QUALSIVOGLIA INDICE MSCI O DI QUALSIASI DATO IVI CONTENUTO. NESSUNA DELLE PARTI MSCI ACCETTA ALCUNA RESPONSABILITÀ PER QUALSIVOGLIA ERRORE, OMISSIONE O INTERRUZIONE DI, O RELATIVI A, QUALSIVOGLIA INDICE MSCI O A QUALSIVOGLIA DATO IVI INCLUSO. INOLTRE, NESSUNA DELLE PARTI MSCI RILASCI ALCUNA GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, DI ALCUN TIPO, E LE PARTI MSCI DECLINANO ESPRESSAMENTE TUTTE LE GARANZIE DI COMMERCIALIZZABILITÀ E IDONEITÀ PER UN FINE SPECIFICO, IN RELAZIONE A CIASCUN INDICE MSCI E A QUALSIVOGLIA DATO IVI CONTENUTO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO NESSUNA DELLE PARTI MSCI AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ IN CASO DI DANNI DIRETTI, INDIRETTI, SPECIALI, PUNITIVI, CONSEGUENZIALI O DI QUALSIASI ALTRO DANNO (IVI INCLUSA LA PERDITA DI PROFITTI) ANCHE QUALORA SIANO STATE INFORMATE DELLA POSSIBILITÀ CHE TALI DANNI SI VERIFICASSERO.

Informazioni Legali / Disclaimer

Le informazioni contenute nel presente documento sono destinate esclusivamente agli investitori istituzionali, agli investitori professionali, "qualificati" o specializzati e agli intermediari finanziari. Non sono destinate alla distribuzione al grande pubblico, alla clientela di privati e ai clienti di istituzioni finanziarie, indipendentemente dalla giurisdizione in vigore, né ai "Cittadini degli Stati Uniti". Inoltre, ogni destinatario di tali informazioni deve essere riconosciuto nell'Unione europea come investitore "professionale", come definito nella direttiva 2004/39/CE del 21 aprile 2004 relativa ai mercati degli strumenti finanziari ("MIFID") o nella regolamentazione nazionale e, nel caso della Svizzera, come "investitore qualificato" ai sensi della vigente legge federale svizzera sulla distribuzione di investimenti collettivi. Le informazioni non possono in alcun modo essere distribuite all'interno dell'Unione europea a investitori non "professionali" come definiti nella direttiva MIFID o, in Svizzera, a investitori che non rispondono alla definizione di "investitore qualificato" secondo la legislazione e la normativa vigenti. Rappresentante: CACEIS Bank, Parigi, Succursale di Nyon/Svizzera, 35 route de Signy, 1260 Nyon, Svizzera (già "CACEIS Bank Luxembourg, Lussemburgo, Succursale di Nyon", Svizzera. Agente pagatore: CA Indosuez (Svizzera) S.A., 4 quai General Guisan, 1204 Ginevra.

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.