

Amundi S&P 500 II UCITS ETF EUR Dist

INFORMES

Comunicación Publicitaria

31/03/2024

RENTA VARIABLE

Datos clave (Fuente : Amundi)

Valor liquidativo : **49,88 (EUR)**
 Fecha de valor liquidativo y activo gestionado : **28/03/2024**
 Activos : **10 687,20 (millones EUR)**
 Código ISIN : **LU0496786574**
 Replication type : **Sintético**
 Índice de referencia : **100% S&P 500**
 Fecha último cupón : **12/12/2023**
 Últimos cupones : **0,4600 (EUR)**
 Primer fecha de Valoración : **26/03/2010**
 Valor liquidativo al inicio : **8,71 (EUR)**

Objetivo de inversión

El Amundi S&P 500 II UCITS ETF EUR Dist es un fondo cotizado (ETF) que cumple con la normativa UCITS, cuyo objetivo consiste en replicar el índice de referencia S&P 500 Net Total Return Index.

Indicador de Riesgo (Fuente: Fund Admin)



Riesgo más bajo Riesgo más alto

El indicador de riesgo presupone que usted mantendrá el producto durante 5 años. El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

Es importante que los inversores evalúen los riesgos descritos a continuación así como en el folleto del fondo (www.amundiETF.com).

CAPITAL EN RIESGO : los ETF son instrumentos de réplica: su perfil de riesgo es similar al de una inversión directa en el índice subyacente. Todo el capital de los inversores está en riesgo y cabe la posibilidad de que los inversores no recuperen el importe invertido originalmente.

RIESGO DE REPLICACIÓN : es posible que no se alcancen los objetivos del fondo a causa de acontecimientos inesperados de los mercados subyacentes que repercutirán en el cálculo del índice y en la replicación eficiente por parte del fondo.

RIESGO DE CONTRAPARTE : los inversores están expuestos a los riesgos derivados del uso de un Swap OTC celebrado con MORGAN STANLEY BANKAG , SOCIETE GENERALE. En consonancia con las directrices de los OICVM, la exposición a contraparte no puede superar el 10% del patrimonio total del fondo.

RIESGO SUBYACENTE : El Índice subyacente de un ETF de Amundi puede ser complejo y volátil. Al invertir en materias primas, el índice subyacente se calcula haciendo referencia a los contratos de futuros sobre materias primas, lo que expone al inversor a un riesgo de liquidez vinculado a los costes, como el coste de transporte. Los ETF expuestos a los Mercados emergentes conllevan un riesgo de pérdida potencial superior a las inversiones en Mercados desarrollados, puesto que están expuestos a un amplio abanico de riesgos impredecibles de los Mercados emergentes.

RIESGO DE CAMBIO: los ETF pueden estar expuestos al riesgo de cambio si el ETF está denominados en una divisa diferente de la del Índice subyacente al que replica. Esto significa que las fluctuaciones del tipo de cambio pueden tener una repercusión positiva o negativa en la rentabilidad.

RIESGO DE LIQUIDEZ: la liquidez la proporcionan los creadores de mercado registrados del mercado bursátil correspondiente donde cotiza el ETF. La liquidez disponible en el mercado puede verse limitada como consecuencia de una suspensión en el mercado subyacente representado por el Índice subyacente que replica el ETF; una avería en los sistemas de uno de los mercados bursátiles correspondientes o de los creadores de mercado; o una situación o un acontecimiento de negociación anómalo.

« Los valores liquidativos técnicos pueden calcularse y publicarse para cualquier día natural (excluidos los sábados y domingos) que no sea un día hábil ni un día de transacciones. Estos valores liquidativos técnicos son meramente indicativos y no constituirán la base para la compra, el cambio, el reembolso o la transferencia de acciones.»

Rentabilidades (Fuente: Fund Admin) -El rendimiento pasado no garantiza los resultados futuros

Evolución del resultado (VL) * (Fuente : Fund Admin)



Rentabilidades* (Fuente : Fund Admin)

Desde el	Desde el	1 mes	3 meses	1 año	3 años	5 años	10 años
	29/12/2023	29/02/2024	29/12/2023	31/03/2023	31/03/2021	29/03/2019	31/03/2014
Cartera	13,05%	3,42%	13,05%	30,52%	50,30%	108,53%	325,01%
Índice	12,96%	3,39%	12,96%	30,04%	48,72%	104,37%	308,15%
Diferencia	0,09%	0,03%	0,09%	0,47%	1,58%	4,16%	16,86%

Rentabilidades anuales* (Fuente : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Cartera	21,88%	-12,85%	38,32%	8,56%	33,74%	0,26%	6,90%	15,13%	12,61%	28,99%
Índice	21,41%	-13,17%	37,89%	8,03%	33,10%	-0,15%	6,37%	14,55%	12,22%	28,67%
Diferencia	0,46%	0,32%	0,43%	0,53%	0,63%	0,41%	0,52%	0,58%	0,39%	0,32%

La rentabilidad de los ETF que distribuyen dividendos se calcula teniendo en cuenta la reinversión de estos

* Las rentabilidades arriba indicadas cubren períodos completos de 12 meses para cada año civil. Las rentabilidades pasadas no presuponen en modo alguno los resultados actuales ni futuros, y no garantizan los rendimientos venideros. Los eventuales beneficios o pérdidas no incluyen los gastos, comisiones o tasas soportados por el inversor en el momento de la emisión y la compra de participaciones (p.ej., impuestos, gastos de intermediación u otras comisiones aplicados por el intermediario financiero). Si las rentabilidades se calculan en una divisa distinta al euro, las fluctuaciones de los tipos de cambio (al alza o a la baja) pueden afectar los eventuales beneficios o pérdidas generados. La diferencia corresponde a la diferencia de rentabilidades de la cartera y del índice.

Indicadores de riesgo (Fuente: Fund Admin) *

	1 año	3 años
Volatilidad de la cartera	10,65%	14,78%
Volatilidad del índice	10,65%	14,78%
Tracking Error	0,04%	0,03%
Ratio de Sharpe	2,53	0,87

* La volatilidad es un indicador estadístico que mide la amplitud de las variaciones de un activo respecto a su media. Ejemplo: unas variaciones diarias de +/- 1,5% en los mercados corresponden a una volatilidad anual del 25%. El Tracking Error representa la volatilidad anualizada de las diferencias de rentabilidad entre el ETF y el índice de referencia

RENTA VARIABLE ■

Datos del índice (Fuente : Amundi)

Descripción

El índice S&P 500 Net Total Return Index incluye a las 500 compañías líderes de los sectores punteros de la economía de Estados Unidos y refleja las características de rentabilidad y riesgo del más amplio universo de valores de mayor capitalización bursátil de forma continuada. La metodología completa de construcción del índice está disponible en www.standardandpoors.com.

Características (Fuente : Amundi)

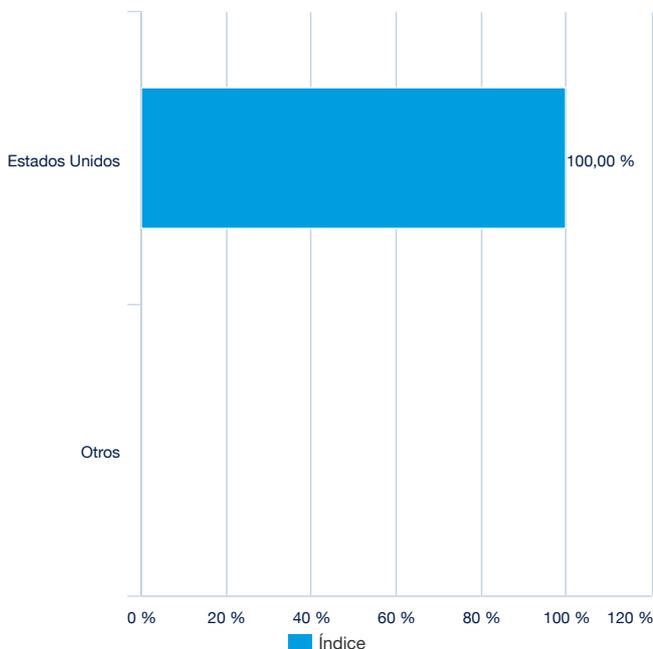
Clase de activo : **Renta variable**
Exposición : **EE.UU.**

total de valores : **503**

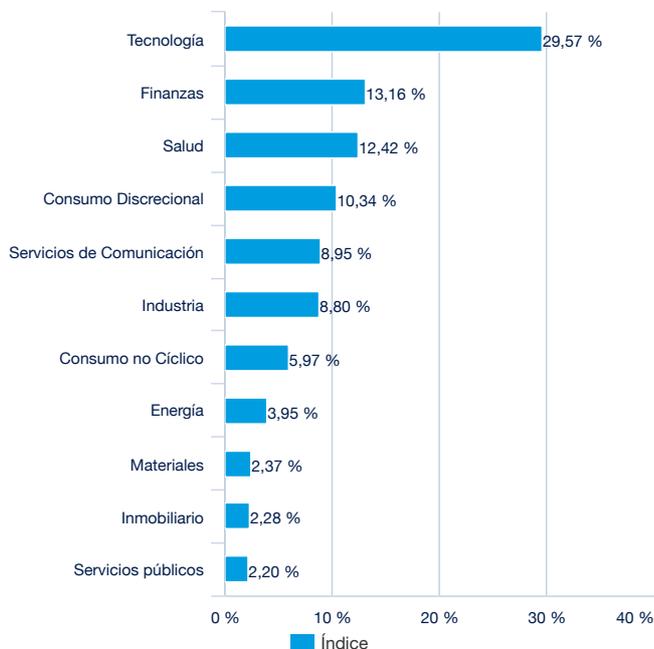
Principales líneas del índice (Fuente : Amundi)

	% de activos (índice)
BROADCOM INC	1,32%
ELI LILLY & CO	1,41%
ALPHABET INC CL C	1,70%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,74%
ALPHABET INC CL A	2,02%
META PLATFORMS INC-CLASS A	2,42%
AMAZON.COM INC	3,74%
NVIDIA CORP	5,06%
APPLE INC	5,65%
MICROSOFT CORP	7,09%
Total	32,16%

Distribución geográfica (Fuente : Amundi)



Distribución sectorial (Fuente : Amundi)



RENTA VARIABLE ■

Datos de cotización del ETF (Fuente : Amundi)

Sitio	Horarios	Divisa	Mnemo	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	SP5	SPX IM	LYPSEUIV	LYXSP.MI	LYPSEUIV
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	SP5	SP5 FP	LYPSEUIV	SP5.PA	LYPSEUIV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	SP5	LYPS GY	LYPSEUIV	LYXSP.DE	LYPSEUIV
Warsaw Stock Exchange	09:00 - 16:50	PLN	SP5	LYPS PW	LYPSPLIV	ETFSP500.WA	LYPSPLIV

Características principales (Fuente : Amundi)

Forma jurídica	IICVM de Derecho luxemburgués
Normativa UCITS	OICVM
Sociedad gestora	Amundi Luxembourg SA
Sub Delegación Financiera	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Custodio	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Auditor Externo	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Fecha de creación	26/03/2010
Divisa de referencia de la clase	EUR
Clasificación	Non aplicable
Asignación de los resultados	Distribución
Código ISIN	LU0496786574
Mínimo de suscripción mercado secundario	1 Participación(es)
Valoración	Diaria
Gastos corrientes	0,07% (realizado) - 02/06/2023
Gastos de entrada (máximo)	5,00%
Gastos de salida (máximo)	5,00%
Cierre fiscal	Septiembre

Índices Proveedores

EL SUBFONDO NO ES FINANCIADO, PROMOCIONADO, VENDIDO NI PROMOVIDO POR STANDARD & POOR'S O POR SUS FILIALES ("S&P"). S&P NO SIRVE COMO REPRESENTACIÓN, CONDICIÓN O GARANTÍA, EXPLÍCITA O IMPLÍCITA, PARA LOS PROPIETARIOS DEL SUBFONDO NI PARA NINGÚN MIEMBRO PÚBLICO RELACIONADO CON EL ASESORAMIENTO SOBRE INVERSIÓN EN VALORES DE MANERA GENERAL O DE MANERA PARTICULAR EN EL SUBFONDO. TAMPOCO QUEDA SUPUESTA LA CAPACIDAD DEL ÍNDICE S&P 500 PARA SEGUIR LA RENTABILIDAD DE DETERMINADOS MERCADOS FINANCIEROS Y/O SECCIONES DE LOS MISMOS, Y/O GRUPOS DE ACTIVOS O CLASES DE ACTIVOS.

LA ÚNICA RELACIÓN ENTRE S&P Y SOCIEDAD GESTORA ES LA LICENCIA DE DETERMINADAS MARCAS REGISTRADAS Y NOMBRES COMERCIALES Y DE S&P 500, QUE ES DETERMINADO, COMPUESTO Y CALCULADO POR S&P SIN GUARDAR RELACIÓN CON SOCIEDAD GESTORA O CON EL SUBFONDO. S&P NO TIENE LA OBLIGACIÓN DE CONSIDERAR LAS NECESIDADES DE SOCIEDAD GESTORA NI DE INVERSORES A LA HORA DE DETERMINAR, COMPONER O CALCULAR EL ÍNDICE S&P 500.

S&P NO ES RESPONSABLE Y NO HA PARTICIPADO EN LA DETERMINACIÓN DE LOS PRECIOS DEL SUBFONDO NI DEL VL, EN LA ELECCIÓN DEL MOMENTO DE EMISIÓN O DE VENTA DEL SUBFONDO O EN EL CÁLCULO DE LA ECUACIÓN POR MEDIO DE LA CUAL LAS ACCIONES DEL FONDO SE CONVIERTEN EN EFECTIVO. S&P NO TIENE OBLIGACIÓN NI RESPONSABILIDAD EN RELACIÓN CON LA ADMINISTRACIÓN, LA COMERCIALIZACIÓN O LA NEGOCIACIÓN DEL SUBFONDO.

S&P NO GARANTIZA LA PRECISIÓN Y/O LA INTEGRIDAD DEL ÍNDICE S&P 500 NI DE LOS DATOS QUE SE INCLUYEN EN ÉL.

S&P NO SERÁ RESPONSABLE POR LOS ERRORES, LAS OMISIONES O LAS INTERRUPCIONES QUE PUEDAN AFECTAR AL ÍNDICE.

S&P NO SIRVE COMO REPRESENTACIÓN, CONDICIÓN O GARANTÍA, EXPLÍCITA O IMPLÍCITA, EN RELACIÓN CON LOS RESULTADOS OBTENIDOS POR SOCIEDAD GESTORA, POR LOS INVERSORES O POR CUALQUIER OTRA PERSONA O ENTIDAD DEL USO DEL ÍNDICE S&P 500 O CUALQUIERA DE LOS DATOS INCLUIDOS EN ÉL. S&P NO OFRECE GARANTÍAS, EXPLÍCITAS O IMPLÍCITAS, NI REPRESENTACIONES O CONDICIONES Y RENUNCIA EXPRESAMENTE A TODAS LAS GARANTÍAS O CONDICIONES DE COMERCIALIZACIÓN Y ADECUACIÓN PARA UN FIN O USO PARTICULAR, O A CUALQUIER OTRA GARANTÍA O CONDICIÓN, EXPLÍCITA O IMPLÍCITA, RESPECTO AL ÍNDICE S&P 500 O A LOS DATOS INCLUIDOS EN ÉL. SIN LIMITAR NINGUNO DE LOS PUNTOS ANTERIORES, EN NINGÚN CASO S&P TENDRÁ NINGUNA RESPONSABILIDAD POR DAÑOS ESPECIALES, PUNITIVOS, INDIRECTOS O CONSECUENCIALES (INCLUYENDO LA PÉRDIDA DE BENEFICIOS) QUE RESULTEN

RENTA VARIABLE ■

Menciones legales

El presente documento tiene carácter comercial y no reglamentario.

Es responsabilidad de cada inversor comprobar si la suscripción o la inversión en este producto están permitidas.

Antes de realizar cualquier inversión en el producto, los inversores deben solicitar asesoramiento financiero, fiscal, contable y jurídico independiente.

Amundi S&P 500 II es una sociedad de inversión de capital variable (SICAV) constituida con arreglo a la legislación luxemburguesa, incluida en la lista oficial de organismos de inversión colectiva, autorizada según la Parte I de la Ley de Luxemburgo de 17 de diciembre de 2010 (la «Ley de 2010») relativa a organismos de inversión colectiva de conformidad con las disposiciones de la Directiva 2009/65/CE (la «Directiva de 2009») y sujeta a la supervisión de la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). El producto es un subfondo de Amundi S&P 500 II y ha sido aprobado por la CSSF; la comercialización del producto en Francia ha sido notificada a la AMF.

Amundi Asset Management («Amundi AM ») y Amundi Asset Management recomiendan a los inversores que lean detenidamente el apartado sobre «factores de riesgo» del folleto del producto, así como el apartado sobre «riesgo y remuneración» del documento de datos fundamentales para el inversor (KIID). El folleto (en inglés) y el KIID (en francés) pueden obtenerse, sin cargo alguno, en el sitio web www.amundiETF.com o enviando un correo electrónico a info@amundiETF.com

Los inversores deben tener en cuenta que el folleto solo está disponible en inglés.

Por lo general, las participaciones de un UCITS ETF específico gestionadas por un gestor de activos y adquiridas en el mercado secundario no pueden volverse a vender directamente al mismo gestor de activos. Los inversores deben comprar y vender las participaciones en un mercado secundario con la ayuda de un intermediario (por ejemplo, un corredor de bolsa o broker) y podrían soportar comisiones por ello. Además, puede que los inversores tengan que abonar un importe superior al valor liquidativo en vigor cuando compren participaciones y pueden recibir un importe inferior al valor liquidativo en vigor cuando vendan dichas participaciones.

La composición actualizada de la cartera de inversiones del producto está disponible en www.amundiETF.com. Asimismo, el valor liquidativo indicativo se publica en las páginas de Reuters y Bloomberg relativas al producto, y también puede mencionarse en los sitios web de las bolsas de valores en las que cotiza el producto.

No existe garantía alguna de que se vaya a lograr el objetivo del fondo. Es posible que el fondo no pueda replicar exactamente y en todo momento la rentabilidad del índice (o índices).

Este producto comporta el riesgo de pérdida de capital. El valor del reembolso de este producto puede ser menor que el importe invertido originalmente. En el peor de los casos, los inversores podrían tener que asumir la pérdida total de su inversión. El índice al que se hace referencia en el presente documento (el «Índice») no está patrocinado, aprobado o vendido por Amundi Asset Management («Amundi AM »), Amundi AM no asumen responsabilidad alguna a este respecto. No se ofrece garantía alguna sobre la exactitud, la integridad o la relevancia de la información obtenida de fuentes externas, si bien dichas fuentes se consideran razonablemente fidedignas. Sin perjuicio de cualesquiera leyes aplicables, Amundi AM no asumen responsabilidad alguna a este respecto. La información sobre el mercado que figura en el presente documento se basa en los datos de un momento dado y puede variar periódicamente.

ESTE DOCUMENTO NO CONSTITUYE UNA OFERTA PARA LA COMPRA DE VALORES EN LOS ESTADOS UNIDOS DE AMÉRICA. EL PRODUCTO DESCRITO EN EL PRESENTE DOCUMENTO NO SERÁ REGISTRADO CON ARREGLO A LA LEY DE VALORES DE 1933 DE ESTADOS UNIDOS, EN SU VERSIÓN MODIFICADA (LA «LEY DE VALORES ESTADOUNIDENSE») Y NO PODRÁ SER OFRECIDO NI VENDIDO EN LOS ESTADOS UNIDOS DE AMÉRICA SIN HABER SIDO REGISTRADO O SIN HABER RECIBIDO LA EXENCIÓN DEREGISTRO DE CONFORMIDAD CON LA LEY DE VALORES ESTADOUNIDENSE.

Amundi Asset Management cuenta con la debida autorización para operar en España como sociedad gestora de instituciones de inversión colectiva y fondos de inversión en régimen de libre prestación de servicios y, a este efecto, está inscrita en el registro oficial correspondiente de la autoridad reguladora española (CNMV) con el número 17.