

# Lyxor MSCI USA ESG BROAD CTB (DR) UCITS ETF - Dist

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/10/2022

ACTION ■

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **370,01 (EUR)**  
 Date de VL et d'actif géré : **31/10/2022**  
 Actif géré : **1 317,13 (millions EUR)**  
 Code ISIN : **FR0010296061**  
 Type de Réplication : **Physique**  
 Indice de référence :  
**100% MSCI USA ESG BROAD SELECT CTB**  
 Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**  
 Date du dernier coupon : **06/07/2022**  
 Derniers Coupons : **2,40 (EUR)**  
 Date de la première VL : **23/03/2006**  
 VL de lancement : **102,03 (EUR)**

## Objectif d'investissement

Lyxor MSCI USA ESG Broad CTB (DR) UCITS ETF - Dist est un ETF (exchange traded fund) conforme à la Directive OPCVM. Il a pour objectif de répliquer, à la hausse comme à la baisse, l'indice de référence MSCI USA ESG CTB Broad Select Net Total Return Index.

Les ETF Amundi sont des fonds d'investissement cotés en bourse qui procurent une exposition fidèle et bon marché à un indice de référence.

## Profil de risque et de rendement (SRII) (Source : Fund Admin)



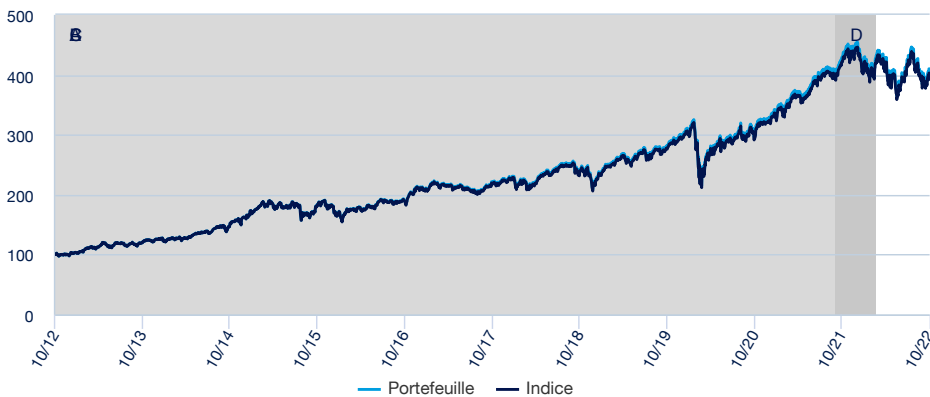
⚡ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

⚡ A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

Le SRII correspond au profil de risque et de rendement présent dans le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (DICI). La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Il n'est pas garanti et pourra évoluer dans le temps.

## Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

### Evolution de la performance (VL) \* (Source : Fund Admin)



A : Jusqu'au 03/10/2021, les performances du Fonds indiquées correspondent à un mode de réplification indirecte de l'Indice de Référence. A partir du 04/10/2021, les performances du Fonds indiquées correspondent à un mode de réplification directe de l'Indice de Référence.

B : Jusqu'au 20/09/2018, les performances du Fonds indiquées correspondent à celles du FCP - LYXOR MSCI USA UCITS ETF (le Fonds absorbé). Ce dernier a été absorbé par le Fonds le 20/09/2018.

C : Jusqu'au 06/10/2021, l'Indice de Référence du Fonds était le MSCI USA Net Total Return Index.

D : Jusqu'au 23/03/2022, l'Indice de Référence du Fonds était le MSCI USA ESG CTB Broad Select Net Total Return Index.

### Performances glissantes \* (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le 31/12/2021	1 mois 30/09/2022	3 mois 29/07/2022	1 an 29/10/2021	3 ans 31/10/2019	5 ans 31/10/2017	10 ans 31/10/2012
<b>Portefeuille</b>	-8,65%	6,65%	-3,66%	-4,50%	46,56%	86,37%	309,95%
<b>Indice</b>	-8,63%	6,65%	-3,66%	-4,45%	46,04%	84,84%	302,80%
<b>Ecart</b>	-0,02%	0,01%	0,00%	-0,05%	0,52%	1,53%	7,15%

### Performances calendaires \* (Source : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
<b>Portefeuille</b>	36,27%	10,99%	33,56%	-0,01%	6,84%	14,60%	12,35%	28,35%	26,20%	13,77%
<b>Indice</b>	36,10%	10,75%	33,28%	-0,25%	6,45%	14,21%	12,16%	28,33%	26,10%	13,56%
<b>Ecart</b>	0,17%	0,24%	0,27%	0,24%	0,39%	0,39%	0,19%	0,02%	0,10%	0,21%

Les performances des ETF de distribution sont calculées en réinvestissant les dividendes dans la performance de l'ETF

\* Source : Amundi. Les performances ci-dessus couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile. **Les performances passées ne préjugent en rien des résultats actuels et futurs et ne sont pas garanties des rendements à venir.** Les gains ou pertes éventuels ne prennent pas en compte les frais, commissions et redevances éventuels supportés par l'investisseur lors de l'émission et du rachat des parts (ex : taxes, frais de courtage ou autres commissions prélevés par l'intermédiaire financier...). Si les performances sont calculées dans une devise autre que l'euro, les gains ou les pertes éventuellement générés peuvent de ce fait être impactées par les fluctuations des taux de change (à la hausse comme à la baisse). L'écart correspond à la différence de performance du portefeuille et de l'indice.

### Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement
<b>Volatilité du portefeuille</b>	20,73%	20,93%	18,54%
<b>Volatilité de l'indice</b>	20,72%	20,92%	18,55%
<b>Tracking Error ex-post</b>	0,09%	0,05%	1,01%
<b>Ratio de Sharpe</b>	-0,20	0,66	0,49

## ACTION ■

## Données de l'indice (Source : Amundi)

## Description de l'indice

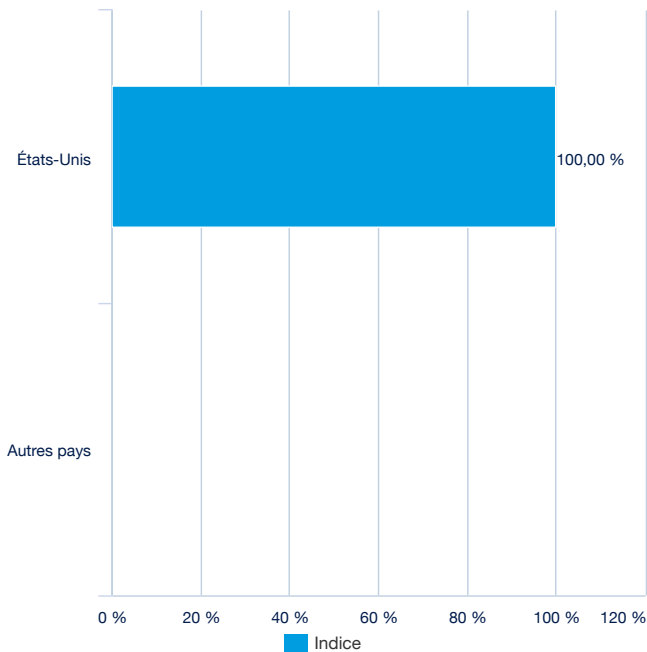
Cet indice a un univers d'investissement identique à celui de l'indice MSCI USA (indice parent). Il recouvre des titres de moyennes et larges capitalisations, visant à représenter 85 % de la capitalisation boursière, ajustée du flottant de chaque groupe industriel sur le marché américain. Un filtre ESG est intégré à l'univers d'investissement pour exclure les sociétés exposées à des activités controversées et/ou à des controverses ESG majeures. En outre, en matière de transition climatique, l'ETF répond aux exigences minimales du règlement de l'UE (EU CTB). Pour plus d'informations sur l'indice, nous vous invitons à consulter [www.msci.com](http://www.msci.com). Pour de plus amples informations, veuillez-vous référer au KIID et au prospectus du fonds.

## Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Action**  
Exposition : **USA**

Nombre de valeurs : **563**

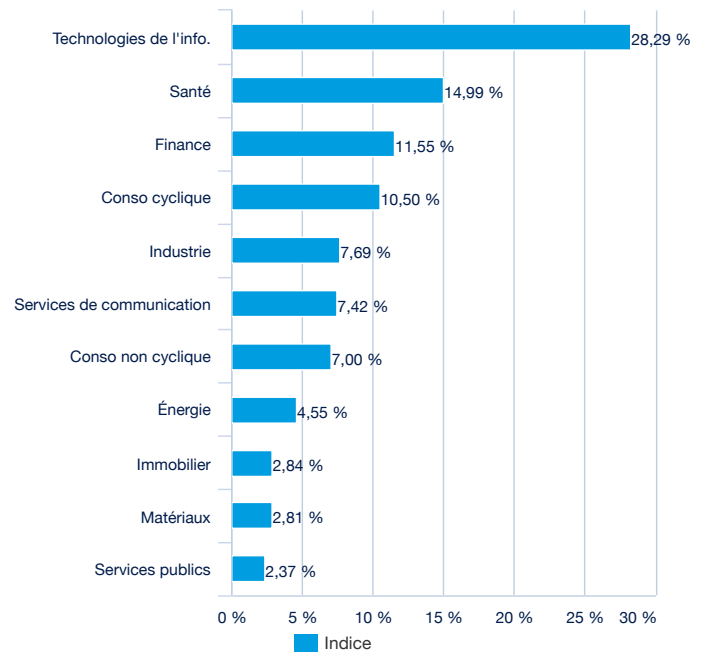
## Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



## Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
APPLE INC	7,32%
MICROSOFT CORP	5,17%
AMAZON.COM INC	2,74%
TESLA INC	1,80%
ALPHABET INC CL A	1,59%
ALPHABET INC CL C	1,58%
UNITEDHEALTH GRP INC	1,31%
JOHNSON & JOHNSON	1,19%
PEPSICO INC	1,13%
JPMORGAN CHASE & CO	1,13%
<b>Total</b>	<b>24,96%</b>

## Secteurs de l'indice (source : Amundi)



## ACTION ■

## Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme Juridique	SICAV de droit français
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Asset Management
Valorisateur	SOCIETE GENERALE
Dépositaire	SGSS - Paris
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT
Date de création de la classe	20/09/2018
Date de la première VL	23/03/2006
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Actions internationales
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation et/ou Distribution
Code ISIN	FR0010296061
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,21% ( prélevés ) - 26/09/2022
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	-
Clôture fiscale	Octobre
Teneur marché principal	SOCIETE GENERALE / LANG & SCHWARZ

## Données de cotation de l'ETF (source : Amundi)

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	USA	USA FP	LUSAIV	USA.PA	LUSAIV
London Stock Exchange	9:00 - 17:30	GBP	USA	USAL LN	USALIV	USAL.L	USALIV
London Stock Exchange	9:00 - 17:30	USD	USA	USAU LN	LYUSAIV	USAU.L	LYUSAIV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	USA	LYXUSA GY	LUSAIV	LYXUSA.DE	LUSAIV
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	USA	LUSA IM	LUSAIV	LUSA.MI	LUSAIV
Six Swiss Exchange	9:00 - 17:30	USD	USA	LYUSA SW	LYUSAIV	LYUSA.S	LYUSAIV

## Contact

## Contact ETF vente

France & Luxembourg	+33 (0)1 76 32 65 76
Allemagne & Autriche	+49 (0) 69 74 221 358
Italie	+39 02 0065 2965
Suisse (Allemand)	+41 44 588 99 36
Suisse (Français)	+41 22 316 01 51
Royaume-Uni	+44 (0) 20 7074 9321
Pays-Bas	+31 20 794 04 79
Pays Nordiques	+46 8 5348 2271
Hong Kong	+65 64 39 93 50
Espagne	+34 914 36 72 45

## Contact ETF Courtiers

BNP Paribas	+33 (0)1 40 14 60 01
Kepler Cheuvreux	+33 (0)1 53 65 35 25

## Contact Amundi

**Amundi ETF**  
90 bd Pasteur  
CS 21564  
75 730 Paris Cedex 15 - France  
**Hotline** : +33 (0)1 76 32 47 74  
info@amundiETF.com

## Contact ETF Capital Market

Téléphone +33 (0)1 76 32 19 93  
Bloomberg IB Chat Capital Markets Amundi ETF  
Capital Markets Amundi HK ETF

## ACTION ■

## Fournisseurs d'indices

Ce Compartiment n'est ni garanti, ni recommandé, ni vendu, ni promu par MSCI, par une quelconque autre filiale de MSCI ou par l'une quelconque des autres entités participant à la production des indices MSCI. Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI et les indices MSCI sont des marques déposées par MSCI et ses filiales dont le Gestionnaire a acquis la licence à des fins spécifiques.

Ni MSCI, ni une quelconque filiale de MSCI, et aucune des entités participant à la production ou au calcul des indices MSCI, n'a fait une quelconque déclaration ni accordé une quelconque garantie, expresse ou tacite, aux titulaires d'Actions du Compartiment ou, de manière plus générale, au grand public quant à l'opportunité de négocier des actions de fonds en général ou des Actions de ce Compartiment en particulier, ou quant à la capacité d'un quelconque indice MSCI de reproduire la performance du marché mondial des actions. MSCI et ses filiales sont les propriétaires de certains noms et marques déposées et des indices MSCI, lesquels sont compilés, construits et calculés par MSCI sans consulter ni le Gestionnaire, ni le Compartiment.

Ni MSCI, ni l'une quelconque des filiales de MSCI, ni l'une quelconque des entités participant à la production des indices MSCI n'est tenu de prendre en considération les besoins du Gestionnaire ou des titulaires des Actions du Compartiment lorsqu'ils compilent, construisent ou calculent les indices MSCI.

Ni MSCI, ni l'une quelconque des filiales de MSCI, ni l'une quelconque des entités participant à la production des indices MSCI ne prend une quelconque décision concernant la date de lancement, la fixation du prix ou de la quantité d'Actions du Compartiment ou la détermination et le calcul de la formule utilisée pour déterminer la valeur liquidative du Compartiment. MSCI, les filiales de MSCI et les entités participant à la production des indices MSCI déclinent toute responsabilité et n'assument aucune obligation quant à l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment.

Bien que MSCI se procure les données incorporées dans les indices ou utilisées pour calculer ces derniers auprès de sources dont MSCI croit qu'elles sont dignes de foi, ni MSCI, ni une quelconque autre partie participant à la création ou au calcul d'indices MSCI, ne garantit l'exactitude et/ou l'exhaustivité DES INDICES OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉS.

Ni MSCI, ni les entités participant à la création ou au calcul des indices MSCI n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite quant aux résultats que le titulaire d'une licence MSCI, les clients de ce dernier, les contreparties, les titulaires d'unités, parts ou actions de fonds ou toute autre personne physique ou morale tireront de l'utilisation DES INDICES OU DE QUELCONQUES DONNÉES QUI Y SONT INCORPORÉS en ce qui concerne les droits sur lesquels porte cette licence, non plus que pour une quelconque autre fin.

Ni MSCI, ni une quelconque autre partie n'accorde une quelconque garantie, expresse ou tacite, et MSCI récuse toute garantie, quant à la valeur commerciale ou l'adéquation à un but spécifique des indices ou des données qui y sont incorporées. Sous réserve de ce qui précède, en aucun cas MSCI ou une quelconque autre partie ne pourra être tenu pour responsable d'une quelconque perte, qu'elle soit directe, indirecte ou autre (y compris un manque à gagner), même s'il est informé de la possibilité d'une telle perte.

## Avertissement

Le présent document est un document à caractère promotionnel et non de nature réglementaire.

Il appartient à chaque investisseur de s'assurer qu'il est autorisé à souscrire ou à investir dans ce produit.

Avant tout investissement dans ce produit, les investisseurs sont invités à se rapprocher de leurs conseils financiers, fiscaux, comptables et juridiques.

Lyxor MSCI USA ESG BROAD CTB (DR) UCITS ETF est une SICAV de droit luxembourgeois inscrite sur la liste officielle des organismes de placement collectifs soumis à la surveillance de la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) au titre de la Partie I de la loi du 17 décembre 2010, conformément aux dispositions de la Directive UCITS (2009/65/EC).

Le produit est un compartiment de Lyxor MSCI USA ESG BROAD CTB (DR) UCITS ETF qui a obtenu l'agrément de la CSSF et a fait l'objet d'une notification auprès de l'Autorité des Marchés Financiers en vue de sa commercialisation sur le territoire français.

Amundi Asset Management (« Amundi AM ») recommande aux investisseurs de lire attentivement la rubrique « Profil de risque » du prospectus et la rubrique « Profil de risque et de rendement » du Document d'information clé pour l'investisseur du produit (DICI).

Le DICI en langue française, ainsi que le prospectus en langue anglaise, peuvent être obtenus gratuitement sur [info@amundiETF.com](mailto:info@amundiETF.com)

**L'attention de l'investisseur est attirée sur le fait que le prospectus n'est disponible qu'en version anglaise.**

Le produit fait l'objet de contrats d'animation qui visent à assurer la liquidité du produit sur Euronext Paris, dans des conditions normales de marché et de fonctionnement informatique. Les parts ou actions de l'OPCVM coté (« UCITS ETF ») acquises sur le marché secondaire ne peuvent généralement pas être directement revendues à l'OPCVM coté. Les investisseurs doivent acheter et vendre les parts/actions sur un marché secondaire avec l'assistance d'un intermédiaire (par exemple un courtier) et peuvent ainsi supporter des frais. En outre, il est possible que les investisseurs paient davantage que la valeur nette d'inventaire actuelle lorsqu'ils achètent des parts /actions et reçoivent moins que la valeur nette d'inventaire actuelle à la revente. La composition actualisée du portefeuille d'investissement du produit est mentionnée sur le site [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com).

En outre la valeur liquidative indicative figure sur les pages Reuters et Bloomberg du produit et peut également être mentionnée sur les sites internet des places de cotation du produit. Il n'y a aucune garantie que l'objectif du fonds soit atteint. Le fonds peut ne pas toujours être en mesure de répliquer parfaitement la performance de l'indice. Le produit présente un risque de perte en capital. La valeur de remboursement du produit peut être inférieure au montant de l'investissement initial. Dans le pire des scénarii, les investisseurs peuvent perdre jusqu'à la totalité de leur investissement. L'indice mentionné dans le présent document (l'« Indice ») n'est ni parrainé, ni approuvé, ni vendu par Amundi Asset Management (« Amundi AM »). Amundi AM n'assumera une quelconque responsabilité à ce titre. L'exactitude, l'exhaustivité ou la pertinence de l'information provenant de sources externes n'est pas garantie, bien qu'elle ait été obtenue auprès de sources raisonnablement jugées fiables. Sous réserve des lois applicables, Amundi AM n'assume aucune responsabilité à cet égard.

Les éléments du présent document relatifs aux données de marchés sont fournis sur la base de données constatées à un moment précis et qui sont susceptibles de varier.

**LE PRESENT DOCUMENT NE CONSTITUE PAS UNE OFFRE DE VENTE DE TITRES AUX ETATS-UNIS D'AMERIQUE. LE PRODUIT QUI Y EST DECRIT NE SERA PAS ENREGISTRE EN VERTU DU U.S. SECURITIES ACT DE 1933, TEL QUE MODIFIE (LE « U.S. SECURITIES ACT ») ET NE PEUT ETRE NI OFFERT, NI CEDE AUX ETATS-UNIS D'AMERIQUE, SANS AVOIR ETEPREALABLEMENT ENREGISTRE OU EXEMPTÉ D'ENREGISTREMENT EN VERTU DU U.S. SECURITIES ACT.**

Ce document est destiné à être remis exclusivement aux investisseurs institutionnels, professionnels, qualifiés ou sophistiqués et aux distributeurs. Ne doit pas être remis au grand public, à la clientèle privée et aux particuliers au sens de toute juridiction, ni aux « US Persons ». Les investisseurs visés sont, en ce qui concerne l'Union Européenne, les investisseurs « Professionnels » au sens de la Directive 2004/39/CE du 21 avril 2004 « MIF » ou, le cas échéant au sens de chaque réglementation locale et, dans la mesure où l'offre en Suisse est concernée, les « investisseurs qualifiés » au sens des dispositions de la Loi fédérale sur les placements collectifs (LPCC), de l'Ordonnance sur les placements collectifs du 22 Novembre 2006 (OPCC) et de la Circulaire FINMA 08/8 au sens de la législation sur les placements collectifs du 20 Novembre 2008. Ce document ne doit en aucun cas être remis dans l'Union Européenne à des investisseurs non « Professionnels » au sens de la MIF ou au sens de chaque réglementation locale, ou en Suisse à des investisseurs qui ne répondent pas à la définition d'« investisseurs qualifiés » au sens de la législation et de la réglementation applicable.