Amundi Nasdaq-100 Daily (2x) Leveraged UCITS ETF Acc

REPORT MENSILE

31/03/2024

Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : **982,31 (EUR)**
Data di valorizzazione : **28/03/2024**
Patrimonio in gestione : **620,01 (milioni EUR)**
Codice ISIN : **FR0010342592**
Tipo di replica : **Sintetico**
Benchmark :
100% NASDAQ 100 LEVERAGE NOTIONAL NET RETURN
Trattamento fiscale : **Ammesso al PEA**
Prima data di NAV : **27/06/2006**
NAV alla data di istituzione : **15,33 (EUR)**

Obiettivo di investimento

Il Lyxor Nasdaq-100 Daily (2x) Leveraged UCITS ETF - Acc è un exchange-traded fund conforme alla direttiva UCITS che punta a replicare l'indice di riferimento Nasdaq 100 Leveraged Notional Net Total Return Index.

Indicatore di rischio *(Fonte : Fund Admin)*

1 2 3 4 5 6 **7**

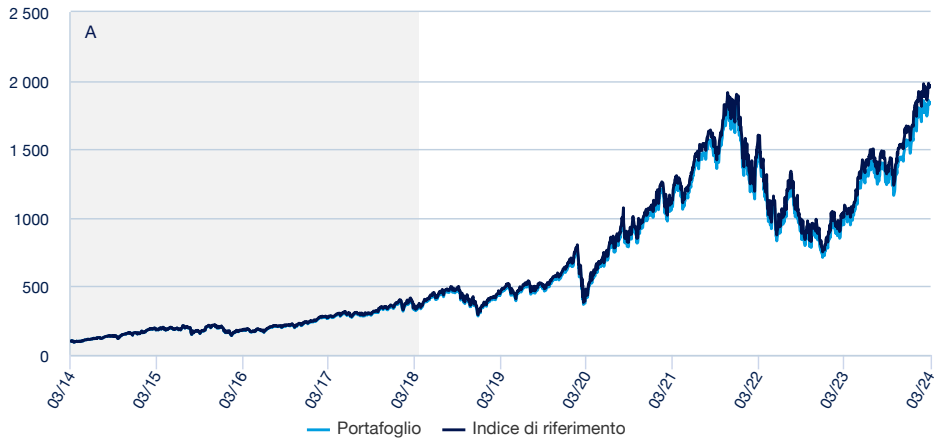
Rischio più basso — Rischio più alto

L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 1 giorno.
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.

I potenziali investitori devono valutare i rischi descritti di seguito e nel prospetto informativo del fondo, disponibile sul sito www.amundietf.com
CAPITALE A RISCHIO : Gli ETF sono strumenti di replica: Il loro profilo di rischio è simile a quello di un investimento diretto nell'Indice sottostante. Il capitale è interamente a rischio e gli investitori potrebbero non recuperare l'importoinizialmente investito.
RISCHIO DI REPLICA : Gli obiettivi del fondo potrebbero non essere conseguiti a causa di eventi imprevisti nei mercati sottostanti, i quali inciderebbero sul calcolo dell'indice e sull' efficiente replica del fondo.
RISCHIO DI CONTROPARTE : Gli investitori sono esposti ai rischi derivanti dall'utilizzo di uno swap OTC con MORGAN STANLEY BANK AG , SOCIETE GENERALE. Conformemente alle linee guida sugli OICVM, l'esposizione acontroparte non pu superare il 10% del patrimonio complessivo del fondo.
RISCHIO SOTTOSTANTE : L'Indice sottostante di un ETF Amundi pu essere complesso e volatile. Se si investe in materie prime, l'Indice sottostante è calcolato in riferimento ai contratti futures su materie prime che espongono l'investitore aun rischio di liquidità legato a costi come quelli di trasporto. Gli ETF con un'esposizione ai Mercati emergenti presentano un rischio di potenziali perdite più elevato rispetto a un investimento nei Mercati sviluppati, poiché essi sono soggetti aun'ampia gamma di rischi imprevedibili nei Mercati emergenti.
RISCHIO DI CAMBIO : Un ETF potrebbe essere esposto al rischio di cambio qualora sia denominato in una valuta diversa da quella dell'Indice sottostante che sta replicando. Cj significa che le fluttuazioni dei tassi di cambio potrebberoavere sul rendimento un effetto negativo coś come positivo.
RISCHIO DI LIQUIDITÀ : la liquidità è fornita dai market maker registrati nelle borse dove gli ETF sono quotati. La liquidità sulle borse può essere limitata a causa di una sospensione del mercato sottostante rappresentato dall'Indice sottostante replicato dall' ETF, di un errore nei sistemi di una delle borse interessate, dei market maker o di una situazione o un evento eccezionale.

Performance (Fonte : Fund Admin) - *I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri*

Performance del fondo * (Fonte : Fund Admin)



A : Jusqu'au 19/04/2018, les performances du Fonds indiquées correspondent à celles du FCP - Lyxor PEA Nasdaq-100 Daily (2x) Leveraged UCITS ETF (le Fonds absorbé). Ce dernier a été absorbé par le Fonds le 19/04/2018.

Performance* (Fonte : Fund Admin)

	Da inizio anno	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni
A partire dal	29/12/2023	29/02/2024	29/12/2023	31/03/2023	31/03/2021	29/03/2019	31/03/2014
Portafoglio	18,06%	1,94%	18,06%	78,25%	65,73%	314,94%	1 719,73%
Benchmark	18,27%	1,99%	18,27%	79,66%	69,36%	327,84%	1 841,19%
Scostamento	-0,21%	-0,05%	-0,21%	-1,41%	-3,63%	-12,90%	-121,46%

Performance annuale* (Fonte : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portafoglio	110,24%	-57,69%	67,05%	74,02%	85,72%	-3,75%	49,17%	12,27%	27,34%	56,06%
Benchmark	111,86%	-57,32%	67,83%	74,77%	86,51%	-3,15%	50,23%	13,15%	28,27%	57,13%
Scostamento	-1,62%	-0,37%	-0,78%	-0,75%	-0,79%	-0,60%	-1,06%	-0,87%	-0,93%	-1,07%

Indicatori di rischio (Fonte : Fund Admin) *

	1 anno	3 anni
Volatilità	30,00%	40,93%
Volatilità dei benchmark	29,96%	40,89%
Tracking Error ex-post	0,05%	0,06%
Sharpe Ratio	2,50	0,38

* 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%.
Il Tracking error rappresenta la volatilità annualizzata delle differenze di perfomance tra l'ETF e il benchmark

** 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.*

Dati dell'indice (Fonte : Amundi)

Descrizione

L'indice Nasdaq 100 Leveraged Notional Net Total Return Index replica l'andamento di una strategia il cui rendimento é pari al doppio di quello del NASDAQ-100 Index (NDX) (l'indice sottostante), con i costi di finanziamento inclusi nella performance dell'indice. Quest'ultimo é costruito tramite la combinazione di una posizione lunga sull'indice sottostante con un'esposizione maggiorata e di un indebitamento ad un determinato tasso d'interesse.

Caratteristiche (Fonte : Amundi)

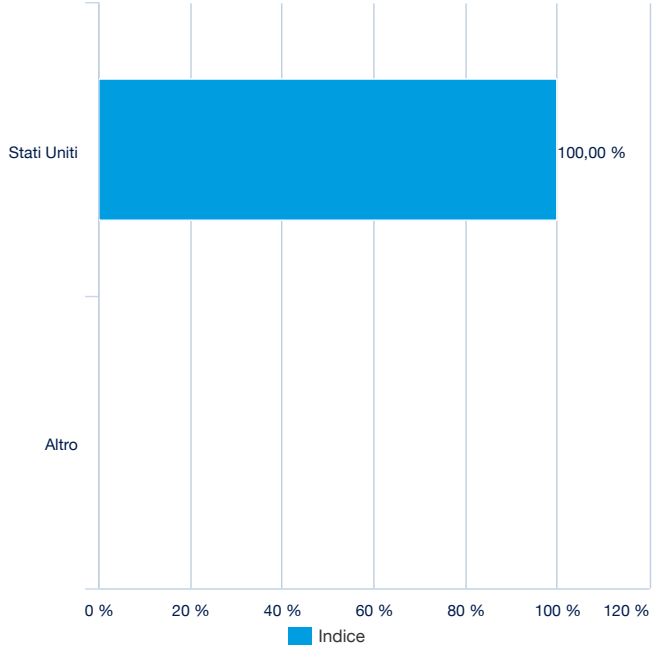
Classe di investimento : **Azionario**
Esposizione : **USA**

Numero di titoli : **101**

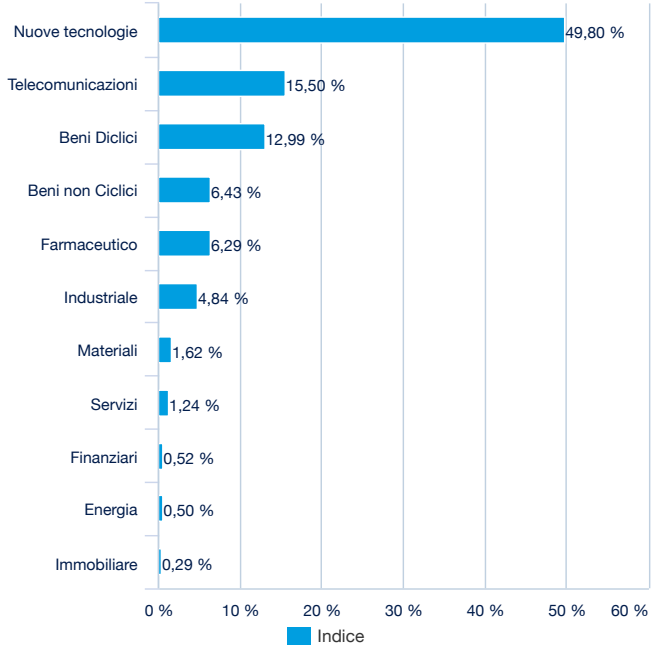
Primi dieci titoli dell'indice (Fonte : Amundi)

	% del peso sul Benchmark
MICROSOFT CORP	8,75%
APPLE INC	7,41%
NVIDIA CORP	6,32%
AMAZON.COM INC	5,25%
META PLATFORMS INC-CLASS A	4,76%
BROADCOM INC	4,44%
ALPHABET INC CL A	2,49%
ALPHABET INC CL C	2,42%
TESLA INC	2,37%
COSTCO WHOLESALE CORP	2,35%
Totale	**46,57%**

Ripartizione geografica (Fonte : Amundi)



Ripartizione settoriale (Fonte : Amundi)



Dati di negoziazione dell'ETF (Fonte : Amundi)

Piazza	Orario	Valuta	Codice	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	LQQ	LQQ FP	LQQIV	LQQ.PA	LQQIV
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	LQQ	LQQ IM	LQQIV	LQQ.MI	LQQIV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	LQQ	L8I7 GY	LQQIV	-	LQQIV

Caratteristiche principali (Fonte : Amundi)

Forma giuridica	OICVM Francese
Normativa europea	OICVM
Società di gestione	Amundi Asset Management
Agente amministrativo	SOCIETE GENERALE
Banca depositaria	SGSS - Paris
Revisore dei Conti	Deloitte & Associés
Data di lancio	27/06/2006
Valuta di riferimento della classe	EUR
Classificazione	Azioni internazionali
Tipologia dei dividendi	Az. ad Accumulazione
Codice ISIN	FR0010342592
Minimo di sottoscrizione mercato secondario	1 Azione/quota
Frequenza di calcolo della quota	Giornaliera
Spese correnti	0,60% (prelevati) - 31/10/2022
Spese di sottoscrizone (massimo)	5,00%
Spese di rimborso (massimo)	5,00%
Chiusura fiscale	Ottobre

Dati Indici

Il/i Prodotto/i non è/sono sponsorizzato/i, approvato/i, venduto/i o promosso/i da The NASDAQ OMX Group, Inc. o dalle sue affiliate (NASDAQ OMX, con le sue affiliate, sono di
seguito denominate le "Società"). Le Società non si sono pronunciate in merito alla legalità o idoneità del/i Prodotto/i, né all'accuratezza o adeguatezza delle descrizioni e delle
informative a esso/i relative. Le Società non rilasciano alcuna dichiarazione o garanzia, esplicita o implicita, ai titolari del/i Prodotto/i o a qualsiasi membro del pubblico in merito
all'opportunità di investire in titoli in generale o nel/i Prodotto/i in particolare o in merito alla capacità dell'Indice Nasdaq-100® di replicare la performance generale del mercato
azionario. L'unica relazione delle Società con Amundi Investment Solutions ("Amundi Asset Management") è la concessione in licenza dei marchi commerciali registrati
NASDAQ®, OMX®, NASDAQ OMX®, Nasdaq-100® e Nasdaq-100 Index® e di alcuni nomi commerciali delle Società, nonché dell'utilizzo dell'Indice Nasdaq-100 ®, che è
determinato, composto e calcolato da NASDAQ OMX senza tenere conto di Amundi Asset Management o del/i Prodotto/i. NASDAQ OMX non ha alcun obbligo di tenere in
considerazione le esigenze di Amundi Asset Management o dei titolari del/dei Prodotto/i nel determinare, comporre o calcolare l'Indice Nasdaq-100®. Le Società non sono
responsabili della né hanno partecipato alla determinazione dei tempi, dei prezzi o del/dei volume/i di emissione del/dei Prodotto/i o al calcolo dell'equazione in base alla quale
il/i Prodotto/i deve/devono essere convertito/i in contanti. Le Società non hanno alcuna responsabilità in relazione all'amministrazione, commercializzazione o negoziazione del/dei Prodotto/i.
LE SOCIETÀ NON GARANTISCONO L'ACCURATEZZA E/O LA CONTINUITÀ DEL CALCOLO DELL'INDICE NASDAQ-100® E DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. LE SOCIETÀ NON RILASCIANO ALCUNA GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE DEVONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI ASSET MANAGEMENT, DAI TITOLARI DEL/DEI PRODOTTO/I, O DA QUALSIASI ALTRO SOGGETTO O ENTITÀ DALL'UTILIZZO DELL'INDICE NASDAQ-100® O DEI DATI IVI INCLUSI. LE SOCIETÀ NON RILASCIANO ALCUNA GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, E DISCONOSCONO ESPRESSAMENTE TUTTE LE GARANZIE DI COMMERCIABILITÀ O IDONEITÀ A UNO SCOPO O UTILIZZO PARTICOLARE RELATIVAMENTE ALL'INDICE NASDAQ-100® O AI DATI IVI INCLUSI. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO LE SOCIETÀ HANNO ALCUNA RESPONSABILITÀ PER EVENTUALI MANCATI PROFITTI O DANNI SPECIALI, INCIDENTALI, PUNITIVI, INDIRETTI O CONSEQUENZIALI, ANCHE SE INFORMATE DEL POSSIBILE VERIFICARSI DI TALI DANNI.

Informazioni Legali / Disclaimer

Il presente documento, predisposto da Société Générale, ha finalità di carattere meramente informativo. Le opinioni, i commenti e i giudizi ivi contenuti hanno solamente natura informativa. Nulla di quanto contenuto in questo documento deve intendersi come sollecitazione o offerta, consulenza in materia di investimenti, legale, fiscale o di altra natura o raccomandazione ad intraprendere qualsiasi investimento negli strumenti finanziari in oggetto. Il presente documento nonè da considerarsi esaustivo e ha solo scopi informativi.
Amundi Asset Management (« Amundi AM » non sono responsabili per eventuali danni, derivanti anche da imprecisioni e/o errori, che possano derivare all'investitore e/o a terzi dall'uso dei dati e delle informazioni contenuti nel presente documento. Le informazioni contenute nel presente documento possono provenire da fonti terze e, nonostante queste siano state utilizzate in quanto ritenute affidabili,Amundi Asset Management (« Amundi AM »), Amundi AM non assumono alcuna responsabilità sulla loro correttezza e completezza.
Il sottoscrittore non dovrà basare la propria decisione di investire nel prodotto sulle informazioni fornitegli nel presente documento bensì dovrà analizzare autonomamente i vantaggi ed i rischi del prodotto sotto gli aspetti legale, fiscale e contabile rivolgendosi, se lo riterrà opportuno, ai propri consulenti specializzati o ad altri professionisti competenti. Amundi AM potranno essere ritenute responsabili delle conseguenze finanziarie o di altra natura derivanti dall' investimento nei prodotti elencati.
La vendita del prodotto ad alcuni soggetti o in alcuni paesi potrebbe essere subordinata a restrizioni normative. Il valore dell'ETF può aumentare o diminuire nel corso del tempo. Si evidenzia che gli ETF rientrano nell'ambito delle disposizioni CONSOB inerenti allo short selling di volta in volta applicabili.
Il valore dell'ETF può aumentare o diminuire nel corso del tempo. Relativamente agli ETF che incorporano un effetto leva, il valore dell'ETF amplierà le oscillazioni al rialzo e/o al ribasso rispetto all'indice di riferimento, nel caso in cui questo non incorpori tale effetto leva. In ogni caso, si consideri che l'ETF potrebbe perdere in misura anche significativa il suo valore.Le commissioni indicate non considerano l'ammontare dell'imposta applicabile ai sensi del vigente regime fiscale e/o l'importo di eventuali commissioni, competenze o altri oneri a carico dell'investitore applicate dal proprio intermediario.L'applicazione del trattamento fiscale dipende dallo specifico status fiscale di ciascun investitore, nonché dalle leggi di volta in volta applicabili in materia. Si consideri, inoltre, che il trattamento fiscale potrà essere modificato in qualsiasi momento. Per ulteriori informazioni, si consiglia di chiedere assistenza al proprio consulente fiscale di fiducia.
I gestori degli indici di riferimento dei citati ETF non sponsorizzano, promuovono, distribuiscono o supportano gli ETF e non danno alcuna garanzia sul valore dell'indice e sui risultati derivanti dal suo uso e non sono responsabili di errori nell'indice.
Prima dell'investimento negli ETF qui menzionati leggere attentamente il Prospetto Completo, il KIID ed il Documento di Quotazione disponibili sul sito www.amundietf.it e presso Amundi Asset Management, Via Cernaia, 8/10, 20121Milano MI, Italie., ove sono illustrati in dettaglio i relativi meccanismi di funzionamento, i fattori di rischio e i costi.