

Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond UCITS ETF Acc

OBLIGATAIRE ■

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **125,56 (EUR)**
Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**
Actif géré : **312,01 (millions EUR)**
Code ISIN : **LU1287023342**
Type de Réplication : **Physique**
Indice de référence :
**100% FTSE EUROZONE HIGHEST RATED
MACRO-WEIGHTED GOVERNMENT BOND (MID
PRICE) INDEX**
Date de la première VL : **06/01/2009**
VL de lancement : **1 000,00 (EUR)**

Objectif d'investissement

Le Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond (DR) UCITS ETF - Acc est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted All-Maturity (EUR).

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 3 ans. L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

Il est important que les investisseurs potentiels évaluent les risques décrits ci-dessous et dans le prospectus du fonds, disponible sur www.amundi-etf.com

- RISQUE EN CAPITAL : Les ETF sont des instruments de réplication : leur profil de risque est similaire à celui d'un investissement direct dans l'Indice sous-jacent. Le capital des investisseurs est entièrement risqué et il se peut que ces derniers ne récupèrent pas le montant initialement investi.

- RISQUE DE REPLICATION : Les objectifs du fonds peuvent ne pas être atteints si des événements inattendus surviennent sur les marchés sous-jacents et ont un impact sur le calcul de l'Indice et l'efficacité de la réplication du fonds.

- RISQUE DU SOUS-JACENT : L'Indice sous-jacent d'un ETF Amundi peut être complexe et volatile. Dans le cas des investissements en matières premières, l'Indice sous-jacent est calculé par rapport aux contrats futures sur matières premières, ce qui expose l'investisseur à un risque de liquidité lié aux coûts, par exemple de portage et de transport. Les ETF exposés aux Marchés émergents comportent un risque de perte potentielle plus élevé que ceux qui investissent dans les Marchés développés, car ils sont exposés à de nombreux risques imprévisibles inhérents à ces marchés.

- RISQUE DE CHANGE : Les ETF peuvent être exposés au risque de change s'ils sont libellés dans une devise différente de celle de l'Indice sous-jacent qu'ils répliquent. Cela signifie que les fluctuations des taux de change peuvent avoir un impact positif ou négatif sur les rendements.

- RISQUE DE LIQUIDITE : La liquidité est fournie par des teneurs de marché enregistrés sur les bourses où les ETF sont cotés. La liquidité sur les bourses peut être limitée du fait d'une suspension du marché sous-jacent représenté par l'Indice sous-jacent suivi par l'ETF, d'une erreur des systèmes de l'une des bourses concernées, des teneurs de marché, ou d'une situation ou d'un événement exceptionnel(le).

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

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



A : Until 21/07/2016, the Funds performances recorded correspond to performances of the LYXOR UCITS ETF EUROMTS HIGHEST RATED MACRO-WEIGHTED GOVT BOND (DR) fund. This fund was absorbed by the Fund on the 21/07/2016.

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le 29/12/2023	1 mois 29/02/2024	3 mois 29/12/2023	1 an 31/03/2023	3 ans 31/03/2021	5 ans 29/03/2019	10 ans 31/03/2014
Portefeuille	-1,31%	0,93%	-1,31%	2,45%	-16,16%	-14,46%	-0,64%
Indice	-1,27%	0,94%	-1,27%	2,59%	-15,79%	-13,80%	0,93%
Ecart	-0,04%	-0,01%	-0,04%	-0,14%	-0,37%	-0,67%	-1,57%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	5,99%	-19,29%	-3,56%	3,65%	3,81%	1,78%	-0,90%	3,81%	0,16%	11,14%
Indice	6,14%	-19,17%	-3,41%	3,83%	3,99%	1,96%	-0,74%	3,99%	0,33%	11,26%
Ecart	-0,15%	-0,11%	-0,15%	-0,18%	-0,18%	-0,18%	-0,16%	-0,18%	-0,17%	-0,13%

* 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 garantes 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
Volatilité du portefeuille	6,19%	7,38%
Volatilité de l'indice	6,19%	7,38%
Tracking Error ex-post	0,01%	0,01%
Ratio de sharpe	-0,21	-0,96

* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an. La Tracking Error représente la volatilité annualisée des différences de performance entre l'ETF et l'indice de référence



Description de l'indice

L'indice MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted All-Maturity (EUR) (code Bloomberg : FMMPHRG5) (l'« Indice de référence ») libellé en EUR reflète la performance des obligations d'Etat de la zone euro les mieux notées. La pondération des obligations dans l'indice repose sur des indicateurs macroéconomiques.

Données du portefeuille (Source : Amundi)

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Obligataire**
Exposition : **Zone Euro**

Nombre de valeurs du portefeuille : **189**

Indicateurs du portefeuille (Source : Fund Admin)

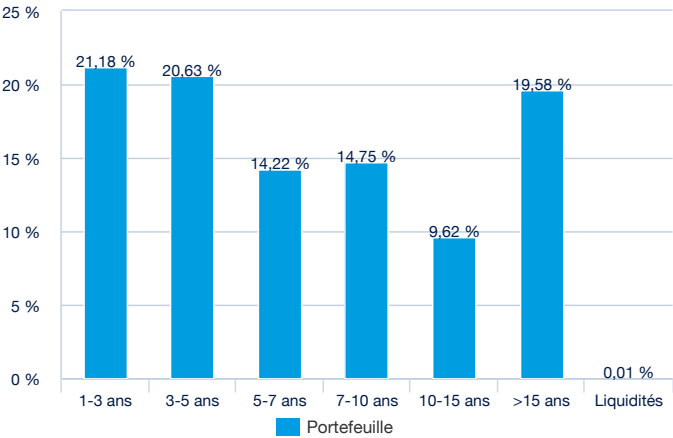
	Portefeuille
Sensibilité ¹	7,69
Notation Moyenne ²	AA+
Taux de rendement	2,61%

¹ La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence

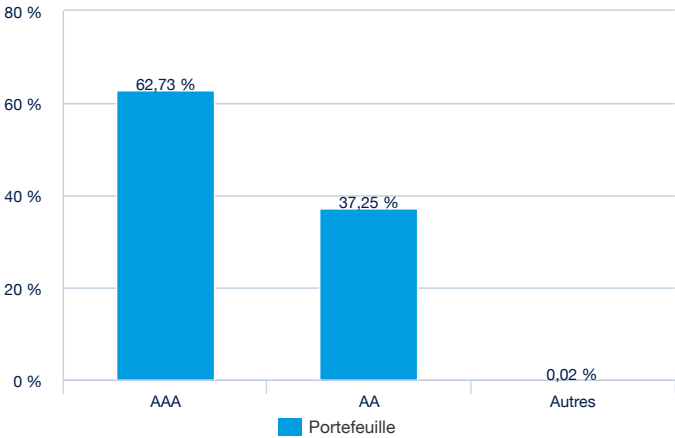
² Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition du portefeuille (Source : Amundi)

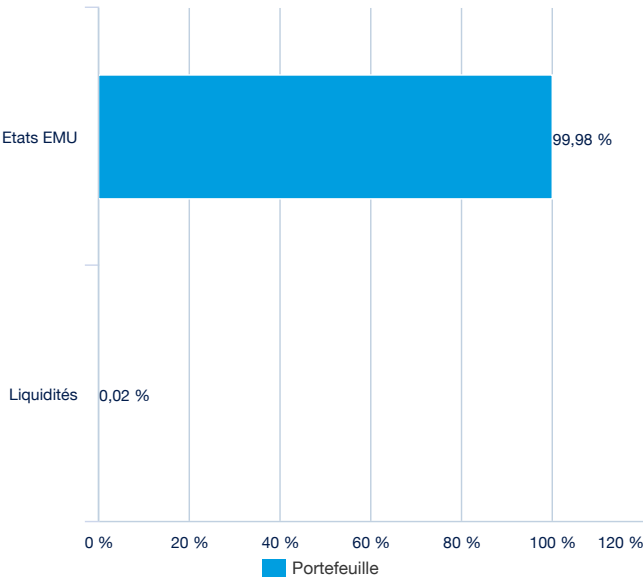
Par maturité (source : Amundi)



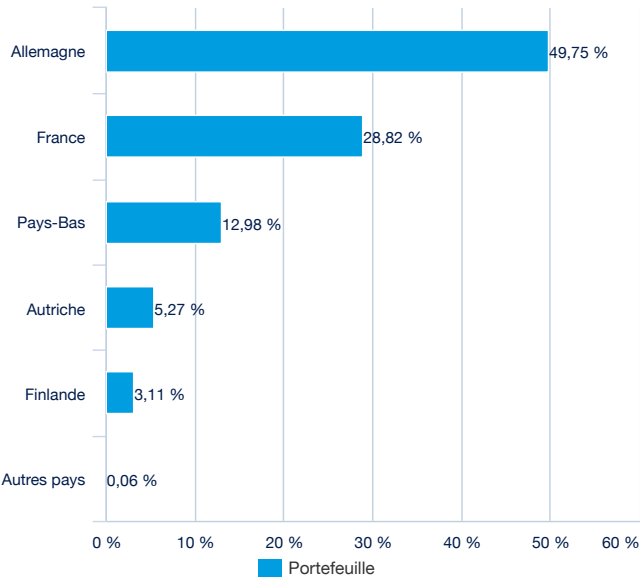
Par notation (source : Amundi)



Par type d'émetteur (source : Amundi)



Par pays (source : Amundi)



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

Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Dépositaire	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	21/07/2016
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1287023342
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,17% (prélevés) - 26/09/2022
Frais d'entrée (maximum)	5,00%
Frais de sortie (maximum)	5,00%
Clôture fiscale	Septembre

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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	MAA	EMAAA IM	MAAIV	EMAAA.MI	MAAIV
Six Swiss Exchange	9:00 - 17:30	EUR	MAA	LYMAA SW	MAAIV	LYMAA.S	MAAIV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	MAA	LYXA GY	MAAIV	LYXA.DE	MAAIV
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	MAA	MAA FP	MAAIV	MAA.PA	MAAIV

Contact**Contact ETF vente**

France & Luxembourg	+33 (0)1 76 32 65 76
Allemagne & Autriche	+49 (0) 800 111 1928
Italie	+39 02 0065 2965
Suisse (Allemand)	+41 44 588 99 36
Suisse (Français)	+41 22 316 01 51
UNITED KINGDOM (Retail)	+44 (0) 20 7 074 9598
UNITED KINGDOM (Instit)	+44 (0) 800 260 5644
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 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

Fournisseurs d'indices

Le compartiment n'est en aucune façon garanti, recommandé, vendu ou promu par FTSE International Limited (« FTSE ») ou les sociétés du London Stock Exchange Group (« LSEG ») (collectivement, les « Parties associées au Concédant ») et aucune Partie associée au Concédant ne formule la moindre affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie de quelque sorte que ce soit, expresse ou tacite, quant (i) aux résultats qui seront obtenus en utilisant l'Indice (sur lequel se fonde le Compartiment), (ii) au niveau de l'Indice à tout moment ou jour particulier, ou autre, ou (iii) à l'adéquation de l'Indice à la finalité pour laquelle il est associé au Compartiment. Aucune des Parties associées au Concédant n'a fourni ni ne fournira de conseils ou recommandations financiers ou d'investissement concernant l'Indice à la Société de gestion ou à ses clients. L'Indice est calculé par FTSE ou par son agent. Aucune Partie associée au Concédant (a) ne pourra être tenue responsable (que ce soit par négligence ou pour toute autre raison) à l'égard de quiconque pour toute erreur dans l'Indice ou (b) n'aura d'obligation d'en informer quiconque. Tous les droits sur l'Indice sont dévolus à FTSE. « FTSE® » est une marque de LSEG utilisée par FTSE sous licence.

Avertissement

Le fonds présente un risque de perte en capital non mesurable. Les performances passées ne préjugent en rien des résultats futurs et ne sont pas garantes des rendements à venir. Pour plus de détails concernant les risques et avant tout investissement, consultez le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (« DICI ») et le prospectus de ce fonds, disponibles en français sur simple demande ou sur le site amundiETF.fr. Les informations contenues dans ce document sont issues de sources considérées comme fiables. Amundi ne peut cependant en garantir l'exactitude et se réserve la possibilité de modifier à tout moment les analyses présentées ci-avant. Ce document non contractuel ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation d'offre, ou une offre d'achat, de vente portant sur le fonds mentionné, et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. La politique de transparence et des informations sur la composition des actifs des fonds sont disponibles sur amundiETF.com. La valeur liquidative indicative est publiée par les bourses. Les parts des Fonds acquises sur le marché secondaire ne peuvent généralement pas être directement revendues au Fonds. Les investisseurs doivent acheter et vendre les parts 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 liquidative actuelle lorsqu'ils achètent des parts et reçoivent moins que la valeur liquidative actuelle à la vente. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire. Liste complète des brokers et market makers disponible sur : amundiETF.com. Des frais d'intermédiaires financiers s'appliquent. Amundi Suisse SA est autorisée en Suisse en tant que distributeur de placements collectifs de capitaux. Amundi Suisse SA distribue en Suisse et à partir de la Suisse des placements collectifs de capitaux gérés par Amundi S.A. et /ou Amundi Luxembourg. A ce titre, Amundi Suisse SA informe les investisseurs qu'elle perçoit d'Amundi S.A. et/ ou d'Amundi Luxembourg, une rémunération au sens de l'article 34 al. 2bis de l'Ordonnance sur les placements collectifs de capitaux. Cette rémunération peut représenter une partie des commissions de gestion prévues dans le prospectus. Toute information complémentaire sur l'existence, la nature et le mode de calcul de la rémunération perçue par Amundi Suisse SA dans le cadre de son activité de distribution en Suisse ou à partir de la Suisse, peut être fournie sur demande écrite adressée à Amundi Suisse SA 6-8 rue de Candolle 1205 Genève Suisse. La distribution de ce fonds en Suisse vise exclusivement des Investisseurs Qualifiés tels que définis dans la LPCC et son ordonnance d'exécution. Le Fonds n'est pas approuvé par la FINMA en vue d'une distribution à des investisseurs non-qualifiés. Les DICI, prospectus, règlements, rapports annuels et/ou semestriels des Fonds peuvent être obtenus sans frais auprès du représentant en Suisse, CACEIS (Switzerland) SA, route de Signy 35, 1260 Nyon. Dans le cadre de la distribution en Suisse, le lieu d'exécution et le for se trouvent au siège du représentant. CREDIT AGRICOLE (SUISSE) SA, 4 Quai Général-Guisan, 1204 Genève, agit comme service de paiement des Fonds en Suisse.