

AMUNDI INDEX US CORP SRI - UCITS ETF DR

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

OBLIGATAIRE

IMPORTANT - A L'ATTENTION DES INVESTISSEURS FRANÇAIS

L'ATTENTION DES INVESTISSEURS EST ATTIRÉE SUR LE FAIT QUE CET OPC PRÉSENTE, AU REGARD DES ATTENTES DE L'AUTORITÉ DES MARCHES FINANCIERS, UNE COMMUNICATION DISPROPORTIONNÉE SUR LA PRISE EN COMPTE DES CRITÈRES EXTRA-FINANCIERS DANS SA GESTION.

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **56,67 (USD)**
Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**
Actif géré : **1 441,45 (millions USD)**
Code ISIN : **LU1806495575**
Type de Réplication : **Physique**
Indice de référence :
100% BLOOMBERG MSCI US CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI

Objectif d'investissement

L'objectif de ce Compartiment est de répliquer la performance de l'Indice Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI (l'« Indice ») et de minimiser l'écart de suivi entre la valeur d'actif nette du Compartiment et la performance de l'Indice. Le Compartiment vise à atteindre un niveau d'écart de suivi du Compartiment et de son indice qui ne dépassera normalement pas 1 %.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

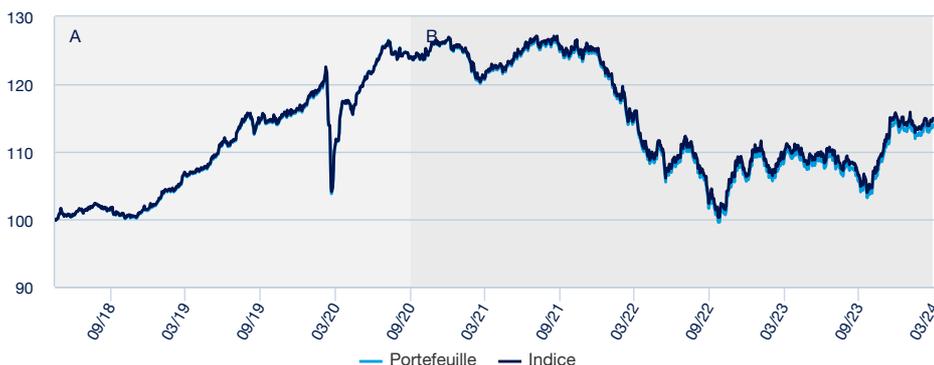
Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 4 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.

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

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



A : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment était Bloomberg Barclays MSCI US Corporate SRI

B : Depuis le début de cette période, l'indicateur de référence du compartiment est Barclays MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI

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	Depuis le 15/05/2018
Portefeuille	-0,46%	1,24%	-0,46%	4,28%	-5,80%	6,85%	14,01%
Indice	-0,42%	1,27%	-0,42%	4,44%	-5,15%	7,58%	14,96%
Ecart	-0,04%	-0,03%	-0,04%	-0,16%	-0,65%	-0,73%	-0,95%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portefeuille	8,24%	-15,29%	-1,53%	9,38%	14,52%
Indice	8,40%	-15,04%	-1,28%	9,27%	14,53%
Ecart	-0,16%	-0,25%	-0,24%	0,11%	-0,01%

* 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 *
Volatilité du portefeuille	7,15%	7,09%	8,08%
Volatilité de l'indice	7,15%	7,08%	8,02%
Tracking Error ex-post	0,08%	0,11%	0,21%
Ratio de sharpe	-0,19	-0,73	0,01

* 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. L'indicateur Tracking Error mesure l'écart de rendement entre le fonds et l'indice

OBLIGATAIRE

Données du portefeuille (Source : Amundi)

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Obligataire**
 Exposition : **International**
 Devise de référence de l'indice : **USD**
 Nombre de valeurs du portefeuille : **4599**

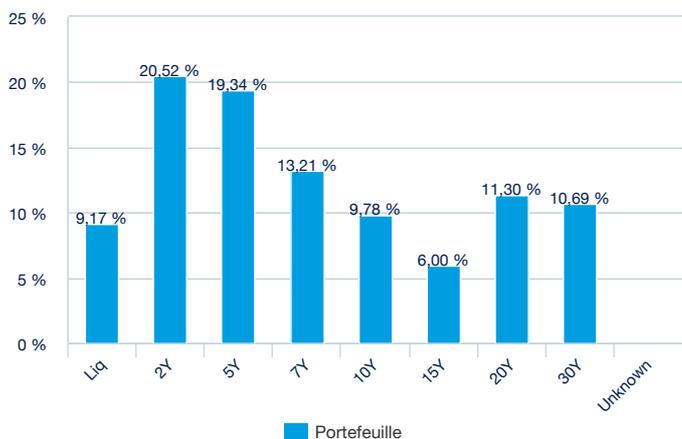
Indicateurs du portefeuille (Source : Fund Admin)

	Portefeuille
Sensibilité ¹	6,70
Notation Moyenne ²	BBB+
Taux de rendement	5,30%

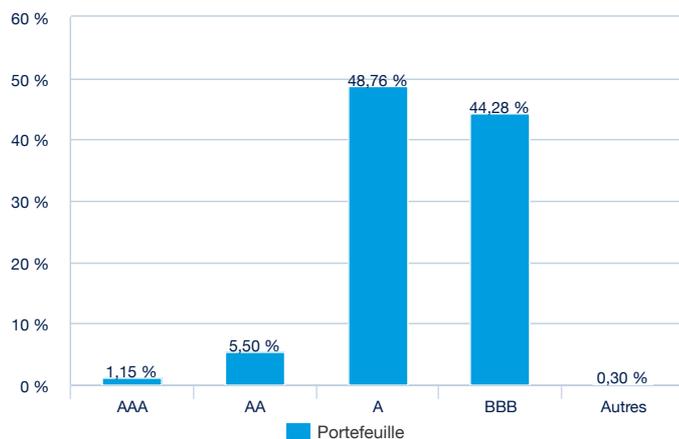
¹ La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence
² Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition du portefeuille (Source : Amundi)

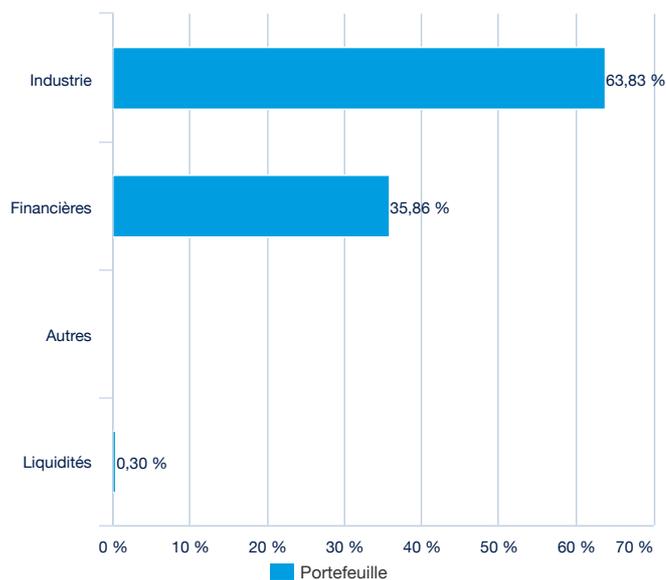
Par maturité (source : Amundi)



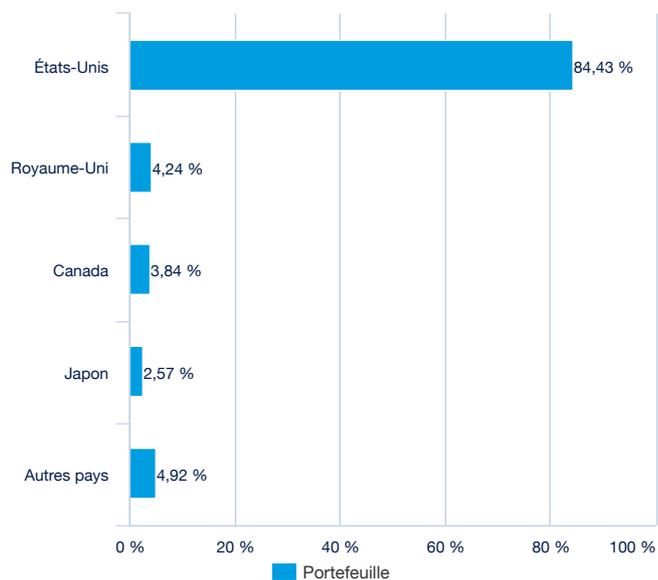
Par notation (source : Amundi)



Par type d'émetteur (source : Amundi)



Par pays (source : Amundi)



OBLIGATAIRE ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Dépositaire	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	24/04/2018
Date de la première VL	15/05/2018
Devise de référence de la classe	USD
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1806495575
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,14% (prélevés) - 08/02/2023
Durée minimum d'investissement recommandée	4 ans
Enveloppe fiscale	-
Clôture fiscale	Décembre
Teneur marché principal	SGCIB

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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
BIVA	-	USD	UCRP	UCRPN MM	-	-	-
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	UCRP	UCRP LN	-	AMUCRPL	-
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	UCRP	UCRP IM	UCRPI	UCRP.MI	UCRPIINAV.PA
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	UCRP	UCRP GY	IUCRP	UCRP.DE	IUCRPIINAV.PA
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	USD	UCRP	UCRP FP	IUCRP	UCRP.PA	IUCRPIINAV.PA

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 ETF Capital Market

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

Contact ETF Courtiers

SG CIB	+33 (0)1 42 13 38 63
BNP Paribas	+44 (0) 207 595 1844

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

OBLIGATAIRE

Fournisseurs d'indices

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc, utilisée sous licence. Bloomberg Finance L.P. et ses sociétés affiliées, y compris Bloomberg Index Services Limited (« BISL ») (collectivement « Bloomberg »), ou les concédants de licence de Bloomberg détiennent l'intégralité des droits de propriété de l'Indice « Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year ».

Ni Bloomberg ni Barclays n'ont de responsabilités, d'obligations ou de devoirs envers les investisseurs d'AMUNDI INDEX EURO AGG SRI. L'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year fait l'objet d'une licence d'utilisation par Amundi Asset Management en tant qu'émetteur de l'Indice AMUNDI EURO CORPORATE SRI 0-3 Y. La seule relation liant Bloomberg et Barclays à l'émission de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year porte sur la licence de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year, qui est déterminé, composé et calculé par BISL, ou toute entité lui succédant, indépendamment de l'émetteur ou de l'Indice AMUNDI EURO CORPORATE SRI 0-3 Y ou des propriétaires de l'Indice AMUNDI INDEX EURO AGG SRI.

En outre, Amundi, Gestionnaire d'actifs d'AMUNDI INDEX EURO AGG SRI peut, en son nom, réaliser une ou plusieurs transactions avec Barclays sur ou concernant l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year en relation avec AMUNDI INDEX EURO AGG SRI. Les investisseurs acquièrent AMUNDI INDEX EURO AGG SRI de la part du Gestionnaire d'actifs Amundi, et les investisseurs n'acquièrent aucun intérêt dans Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year ; Ils ne concluent par ailleurs absolument aucune relation d'affaires avec Bloomberg ou Barclays en effectuant un investissement dans AMUNDI INDEX EURO AGG SRI. Les compartiments AMUNDI INDEX EURO AGG SRI ne sont pas sponsorisés, évalués, vendus ou promus par Bloomberg ni par Barclays. Bloomberg et Barclays ne donnent aucune garantie, explicite ou implicite, pour ce qui est de l'intérêt d'un investissement dans le compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI ou dans des titres quelconques, ni de la capacité de répliquer d'une performance boursière correspondante/relative de la part de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year. Ni Bloomberg, ni Barclays ne s'est prononcé sur la légalité ou l'adéquation du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI en lien avec une personne ou entité quelconque. Ni, Bloomberg, ni Barclays n'est responsable ou partie prenante de la définition des prix des parts à émettre par le compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI pas plus que du calendrier ou des volumes d'émission. Ni Bloomberg, ni Barclays n'est tenu de prendre en compte les besoins de l'Émetteur, des porteurs de parts du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI ou de toute tierce partie dans le cadre de la définition, de la constitution ou du calcul de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year. Ni Bloomberg, ni Barclays n'a d'obligation ou de responsabilité concernant l'administration, la commercialisation ou la négociation de parts du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI.

Le contrat de licence liant Bloomberg et Barclays concerne uniquement ces derniers et aucunement les porteurs de parts du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI, les investisseurs ou d'autres tierces parties. Par ailleurs, le contrat de licence liant Amundi Asset Management et Bloomberg concerne uniquement ces derniers et aucunement les porteurs de parts du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI, les investisseurs ou d'autres tierces parties.

NI BLOOMBERG, NI BARCLAYS NE PEUT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE ENVERS L'ÉMETTEUR, LES INVESTISSEURS OU UNE AUTRE TIERCE PARTIE DE LA QUALITÉ, DE L'EXACTITUDE ET/OU DE L'EXHAUSTIVITÉ DE L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR OU DE TOUTE DONNÉE Y FIGURANT, PAS PLUS QUE DE TOUTE INTERRUPTION DE LA COMMUNICATION DE CE-DERNIER. NI BLOOMBERG NI BARCLAYS NE GARANTIT, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, LES RÉSULTATS DEVANT ÊTRE OBTENUS PAR L'ÉMETTEUR, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, ET PROVENANT DE L'UTILISATION DU BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. BLOOMBERG ET BARCLAYS NE DONNENT AUCUNE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET DÉCLINENT EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER OU D'UTILISATION EN CE QUI CONCERNE L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR OU TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. BLOOMBERG SE RÉSERVE LE DROIT DE MODIFIER SES MÉTHODES DE CALCUL OU DE PUBLICATION DE L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR COMME D'EN CESSER LE CALCUL OU LA PUBLICATION, ET NI BLOOMBERG, NI BARCLAYS NE PEUT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE DE TOUT CALCUL ERRONÉ OU DE TOUTE PUBLICATION INCORRECTE, TARDIVE OU INTERROMPUE RELATIVEMENT À L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR. NI BLOOMBERG, NI BARCLAYS NE PEUT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE DE TOUTS DOMMAGES, DIRECTS OU INDIRECTS, ET DE TOUTE PERTE DE BÉNÉFICES, MÊME SI LE RISQUE A PU EN ÊTRE ÉVOQUÉ, LIÉ À L'UTILISATION DE L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT OU RELATIVE AU COMPARTIMENT AMUNDI INDEX EURO AGG SRI.

L'information fournie par Bloomberg ou Barclays et figurant dans les présentes ne peut être reproduites de quelque manière que ce soit sans l'autorisation écrite préalable de Bloomberg et de Barclays Capital, division banque d'investissement de Barclays Bank PLC. Le siège social de Barclays Bank PLC (enregistrée sous le n° 1026167) est au 1, Churchill Place, Londres E14 5HP, Royaume-Uni.

Avertissement

Ce document est fourni à titre d'information seulement et il ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation ou une offre, un conseil ou une invitation d'achat ou de vente des parts ou actions des FCP, FCPE, SICAV, compartiment de SICAV, SPICAV présentés dans ce document (« les OPC ») et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. Ce document ne constitue pas la base d'un contrat ou d'un engagement de quelque nature que ce soit. Toutes les informations contenues dans ce document peuvent être modifiées sans préavis. La société de gestion n'accepte aucune responsabilité, directe ou indirecte, qui pourrait résulter de l'utilisation de toutes informations contenues dans ce document. La société de gestion ne peut en aucun cas être tenue responsable pour toute décision prise sur la base de ces informations. Les informations contenues dans ce document vous sont communiquées sur une base confidentielle et ne doivent être ni copiées, ni reproduites, ni modifiées, ni traduites, ni distribuées sans l'accord écrit préalable de la société de gestion, à aucune personne tierce ou dans aucun pays où cette distribution ou cette utilisation serait contraire aux dispositions légales et réglementaires ou imposerait à la société de gestion ou à ses fonds de se conformer aux obligations d'enregistrement auprès des autorités de tutelle de ces pays. Tous les OPC ne sont pas systématiquement enregistrés dans le pays de juridiction de tous les investisseurs. Investir implique des risques : les performances passées des OPC présentées dans ce document ainsi que les simulations réalisées sur la base de ces dernières, ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne préjugent pas des performances futures de ces derniers. Les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. Les prospectus complets des OPC de droit français visés par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sont disponibles gratuitement sur simple demande au siège social de la société de gestion. Concernant les mandats de gestion, ce document fait partie du relevé des activités de gestion de votre portefeuille et doit être lu conjointement avec tout autre relevé périodique ou avis de confirmation relatif aux opérations de votre portefeuille, fourni par votre teneur de compte. La source des données du présent document est la société de gestion sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.

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.