

# 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**  
Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**  
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).

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

## 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.

« Les valeurs liquidatives techniques peuvent être calculées et publiées tout jour civil (à l'exception des samedis et des dimanches) qui ne soit ni un jour ouvré ni un jour de transaction. Ces valeurs liquidatives techniques n'ont qu'une valeur indicative et ne serviront pas de base pour l'achat, la conversion, le rachat et/ou le transfert d'actions. »

## 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<br>29/12/2023 | 1 mois<br>29/02/2024 | 3 mois<br>29/12/2023 | 1 an<br>31/03/2023 | 3 ans<br>31/03/2021 | 5 ans<br>29/03/2019 | 10 ans<br>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 impactés 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<br>lancement * |
|----------------------------|-------|-------|--------------------------|
| Volatilité du portefeuille | 6,19% | 7,38% | 5,01%                    |
| Volatilité de l'indice     | 6,19% | 7,38% | 5,02%                    |
| Tracking Error ex-post     | 0,01% | 0,01% | 1,04%                    |
| Ratio de sharpe            | -0,21 | -0,96 | 0,24                     |

\* 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



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)

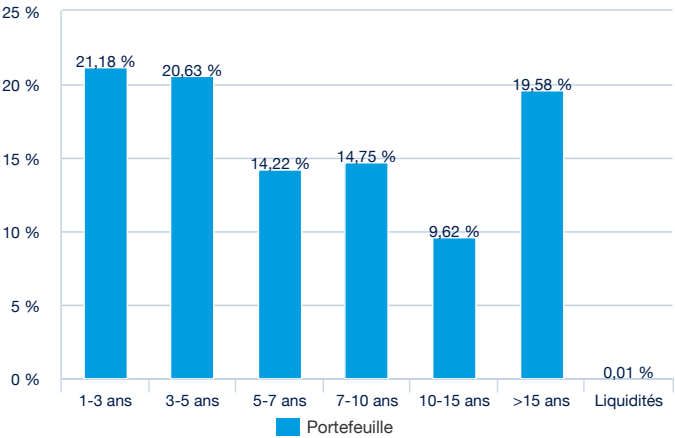
|                               | Portefeuille |
|-------------------------------|--------------|
| Sensibilité <sup>1</sup>      | 7,69         |
| Notation Moyenne <sup>2</sup> | AA+          |
| Taux de rendement             | 2,61%        |

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

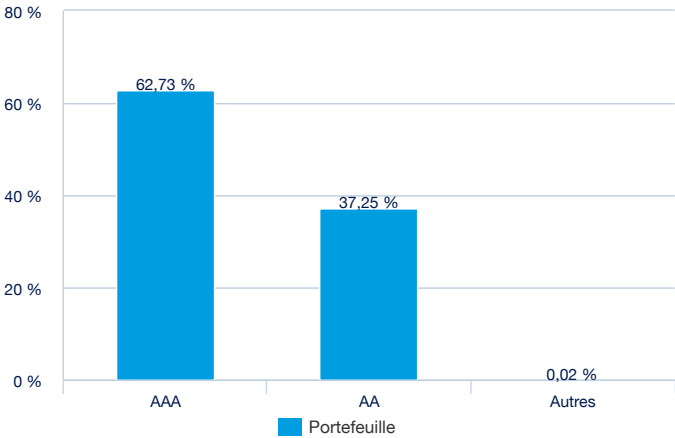
<sup>2</sup> Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition du portefeuille (Source : Amundi)

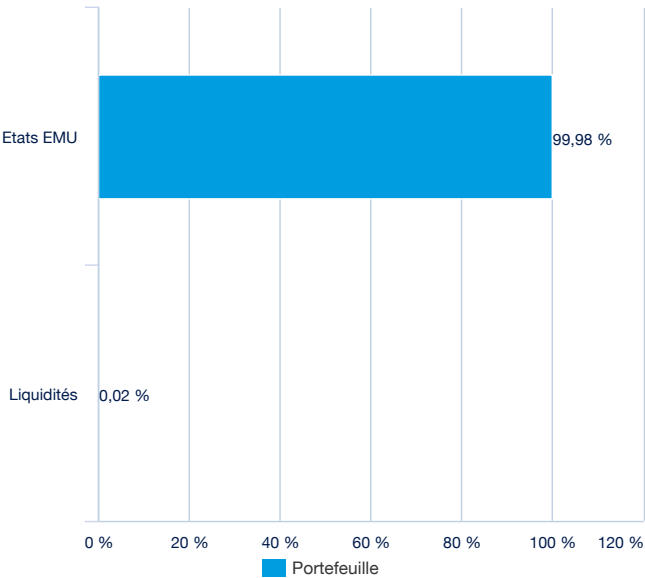
Par maturité (source : Amundi)



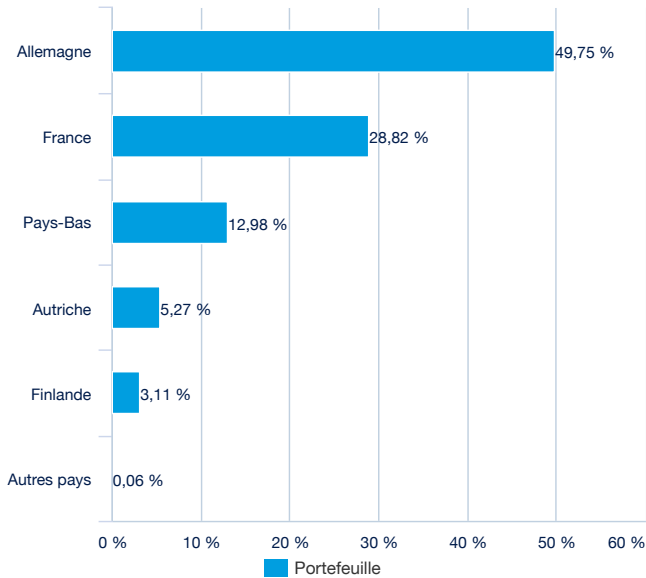
Par notation (source : Amundi)



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                        |
| Date de la première VL                     | 06/01/2009                        |
| 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     |
| Durée minimum d'investissement recommandée | 3 ans                             |
| Enveloppe fiscale                          | -                                 |
| Clôture fiscale                            | Septembre                         |
| 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 |
|---------------------|----------------------|--------|-------|------------------|----------------|-------------|--------------|
| 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 (Insti)  | +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 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

## Contact ETF Capital Market

|                   |                                                             |
|-------------------|-------------------------------------------------------------|
| Téléphone         | +33 (0)1 76 32 19 93                                        |
| Bloomberg IB Chat | Capital Markets Amundi ETF<br>Capital Markets Amundi HK ETF |

## OBLIGATAIRE ■

## 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 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.

Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond 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 Amundi Euro Highest Rated Macro-Weighted Government Bond qui a obtenu l'agrément de la CSSF et a fait l'objet d'une notification auprès de l'Autorité des Marchés Financiers en vu 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@amundi-etf.com](mailto:info@amundi-etf.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 informationnelle. 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.amundi-etf.com](http://www.amundi-etf.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 aucune 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 ETE PREALABLEMENT 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.