

AMUNDI ETF SHORT GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE DAILY UCITS ETF

SYNTHESE DE GESTION

30/11/2017

OBLIGATAIRE ■

Données clés (source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 79,02 (EUR)
 Date de VL et d'actif géré : 30/11/2017
 Actif géré : 43,46 (millions EUR)
 Code ISIN : FR0010821850
 Indice de référence :
 FTSE MTS Short Eurozone Government Broad IG

Objectif d'investissement

AMUNDI ETF SHORT GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF a pour objectif de répliquer au plus près l'évolution de l'indice de stratégie FTSE MTS Short Eurozone Government Broad IG, à la hausse comme à la baisse.

Cet ETF permet une exposition inverse à un portefeuille de titres émis par les gouvernements des Etats membres de la zone euro toutes maturités confondues. Ainsi, sa valeur liquidative évolue à la hausse quand l'indice EuroMTS Eurozone Government Broad All Maturities baisse et vice-versa.

Profil de risque et de rendement (SRII)



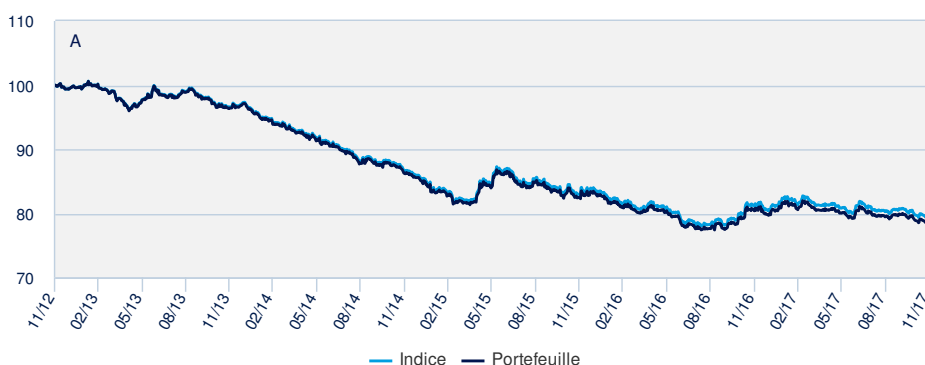
⚡ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

⚡ 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

Evolution de la performance (VL) *



A : L'indice de référence est : Short EuroMTS Investment Grade Broad All Maturities

Performances glissantes *

| Depuis le | Depuis le 30/12/2016 | 1 mois 31/10/2017 | 3 mois 31/08/2017 | 1 an 30/11/2016 | 3 ans 28/11/2014 | 5 ans 30/11/2012 | Depuis le 15/12/2009 |
|---------------------|----------------------|-------------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------|----------------------|
| Portefeuille | -1,67% | -0,39% | -1,09% | -2,31% | -8,90% | -21,41% | -29,98% |
| Indice | -1,48% | -0,38% | -1,05% | -2,10% | -8,32% | -20,56% | -28,83% |
| Ecart | -0,19% | -0,01% | -0,04% | -0,21% | -0,58% | -0,85% | -1,15% |

Performances calendaires *

| | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 | 2012 | 2011 | 2010 | 2009 | 2008 | 2007 |
|---------------------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|------|------|------|
| Portefeuille | -4,01% | -2,46% | -12,11% | -2,23% | -10,48% | -1,38% | -0,27% | - | - | - |
| Indice | -3,81% | -2,25% | -11,89% | -2,04% | -10,30% | -1,19% | -0,10% | - | - | - |
| Ecart | -0,21% | -0,21% | -0,22% | -0,19% | -0,17% | -0,19% | -0,17% | - | - | - |

* 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

| | 1 an | 3 ans | Depuis le lancement |
|-----------------------------------|-------|-------|---------------------|
| Volatilité du portefeuille | 3,54% | 4,36% | 4,38% |
| Volatilité de l'indice | 3,54% | 4,36% | 4,37% |
| Tracking Error ex-post | 0,03% | 0,03% | 0,03% |
| Ratio de Sharpe | -0,58 | -0,63 | -1,02 |

OBLIGATAIRE ■

Données de l'indice

Description

L'indice de stratégie FTSE MTS Short Eurozone Government Broad IG (total return – EUR) est composé de titres émis par les gouvernements des Etats membres de la zone Euro, toutes maturités confondues.

Caractéristiques

Classe d'actif : **Obligataire**
Exposition : **Zone Euro**
Devise de référence de l'indice : **EUR**
Nombre de valeurs : **298**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

| | % d'actifs (indice) |
|--------------------|---------------------|
| OAT 4.25% 10/23 | 0,97% |
| OAT 4.5% 04/41 | 0,93% |
| OAT 5.75% 01-10/32 | 0,92% |
| OAT 3% 04/22 | 0,89% |
| OAT 3.50% 04/26 | 0,79% |
| OAT 3.75% 04/21 | 0,79% |
| OAT 3.25% 10/21 | 0,79% |
| OAT 2.75% 10/27 | 0,78% |
| OAT 5.50% 97-04/29 | 0,78% |
| BTPS 6% 05/31 | 0,74% |
| Total | 8,39% |

Indicateurs de l'indice

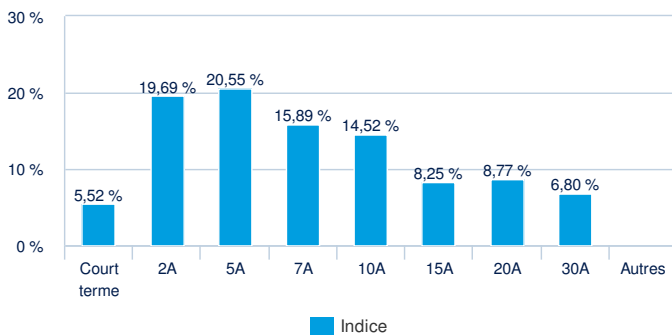
| | Indice |
|--------------------------|--------|
| Sensibilité | 7,50 |
| Taux de rendement | 0,99% |
| Note moyenne | A- |

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

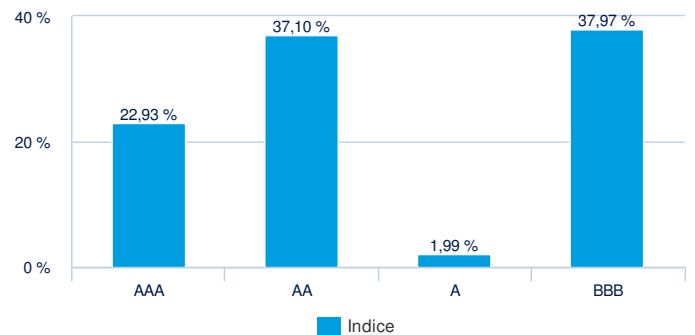
² Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition de l'indice

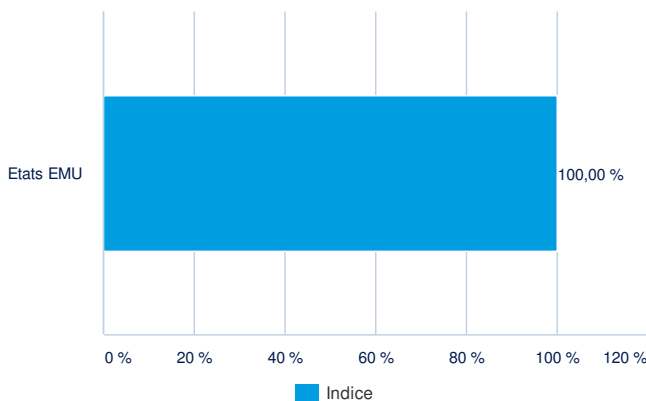
Par maturité



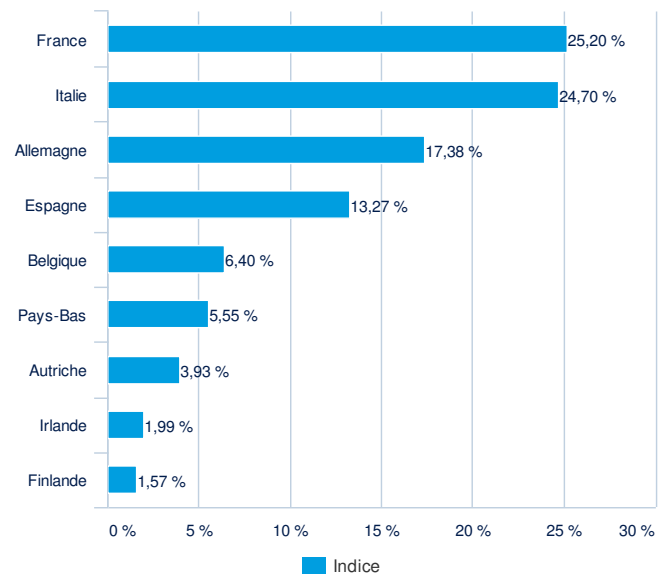
Par notation (source : Amundi)



Par type d'émetteur



Par pays (source : Amundi)



OBLIGATAIRE ■

Caractéristiques principales de la part

| | |
|--|---|
| Forme juridique | Fonds Commun de Placement (FCP) de droit français |
| Norme européenne | OPCVM |
| Société de gestion | Amundi Asset Management |
| Valorisateur | CACEIS Fund Administration France |
| Dépositaire | CACEIS Bank |
| Commissaire aux comptes | PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT |
| Date de création de la classe | 15/12/2009 |
| Devise de référence de la classe | EUR |
| Classification de l'organisme de tutelle | Non applicable |
| Affectation des sommes distribuables | Capitalisation |
| Code ISIN | FR0010821850 |
| Minimum de souscription marché secondaire | 1 part(s) |
| Périodicité de calcul de la VL | Quotidienne |
| Frais courants | 0,14% (prélevés) - 31/03/2017 |
| Durée minimum d'investissement recommandée | 5 ans |
| Enveloppe fiscale | - |
| Clôture fiscale | Mars |
| 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 |
|---------------------|----------------------|--------|-------|------------------|----------------|-------------|--------------|
| Nyse Euronext Paris | 9:05 - 17:35 | EUR | SB0 | SB0 FP | INSB0INAV.PA | SB0.PA | .INSB0 |
| Deutsche Börse | 9:00 - 17:30 | EUR | 540P | SB0GR GR | INSB0INAV.DE | SB0.DE | .INSB0 |
| Borsa Italiana | 9:00 - 17:30 | EUR | SB0 | SB0 IM | INSB0INAV.MI | SB0.MI | .INSB0 |

Contact

Contact ETF vente

| | | |
|----------------------|----------------------|-----------------------|
| France & Luxembourg | Emmanuel Monet | +33 (0)1 76 32 65 76 |
| France | Alex Mendelewitsch | +33 (0)1 76 32 19 62 |
| Allemagne & Autriche | Hermann Pfeifer | +49 (0) 69 74 221 358 |
| Allemagne & Autriche | Bettina May | +49 (0) 69 74 221 323 |
| Allemagne & Autriche | Cem Cayci | +49 (0) 69 74 221 267 |
| Allemagne & Autriche | Sophie Strengé | +49 (0) 69 74 221 318 |
| Iberia & Latam | Laure Rovet Peyranne | +34 (0) 914 367 244 |
| Italie | Vincenzo Sagone | +39 02 0065 2965 |
| Italie | Roberta Gastaldello | +39 02 0065 2121 |
| Suisse | Karin Russell | +41 44 588 99 32 |
| Suisse | Benoit Garcia | +41 22 316 01 51 |
| Suisse | Ivan Durdevic | +41 (0) 44 588 99 33 |
| Royaume-Uni | Philip Philippides | +44 (0) 20 7074 9372 |
| Pays-Bas | Gert-Jan Verhagen | +31 6 3025 3519 |
| Pays Nordiques | Bjorn Sandberg | +46 8 5348 2271 |
| Hong Kong | Sunny Leung | +852 28 27 38 42 |

Contact ETF Capital Market

| | |
|-------------------|---|
| Sabrina Leprovost | +33 (0)1 76 32 19 93 |
| Vincent Annaix | +33 (0)1 76 32 19 15 |
| Olivier Chatelot | +33 (0)1 76 33 93 06 |
| Laurent Verly | +852 2827 3821 |
| 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

Type d'indice répliqué: Obligataire.

L'intégralité des droits relatifs à FTSE MTS (l'« Indice ») revient à MTS Next Limited. « MTS® » est une marque déposée de LSEG et est utilisée sous licence.

Le Fonds a été conçu exclusivement par AMUNDI. L'Indice est calculé par MTS Next Limited ou par son mandataire. MTS Next Limited et ses concédants de licence ne sont pas liés au Fonds et ne le commanditent pas, ne donnent pas de conseils, ne font pas de recommandations à son sujet, ne l'avalisent pas ni n'en font la promotion, et ils déclinent toute responsabilité, quelle qu'elle soit, à l'égard de toute personne découlant (a) de l'utilisation de l'Indice, de la confiance témoignée en l'Indice ou de toute erreur de l'Indice ou (b) de l'investissement dans le Fonds ou de toute opération du Fonds. MTS Next Limited et ses concédants de licence ne font aucune déclaration ou prédiction et ne donnent aucune garantie quant aux résultats devant être obtenus suite à l'utilisation du Fonds ou du caractère adéquat de l'Indice aux fins desquelles il est établi par AMUNDI.

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 revente. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée sous la mention SYNTHESE DE GESTION 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.

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.