

AMUNDI ETF SHORT US TREASURY 7-10 DAILY UCITS ETF

SYNTHESE DE
GESTION

30/11/2017

OBLIGATAIRE ■

Données clés (source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 73,60 (USD)
Date de VL et d'actif géré : 30/11/2017
Actif géré : 80,83 (millions USD)
Code ISIN : FR0010892745
Indice de référence :
Short Markit iBoxx \$ Treasuries 7-10Y

Objectif d'investissement

AMUNDI ETF SHORT US TREASURY 7-10 DAILY UCITS ETF a pour objectif de répliquer au plus près la performance quotidienne de l'indice de stratégie Short Markit iBoxx \$ Treasuries 7-10Y, coupons réinvestis (total return), en USD, quelle que soit son évolution, positive ou négative.

Profil de risque et de rendement (SRRI)



▲ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

▲ A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

Le SRRI correspond au profil de risque et de rendement présent dans le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (DIC). 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) *



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 17/06/2010
Portefeuille	-1,01%	0,46%	2,35%	-0,71%	-3,37%	-5,29%	-23,42%
Indice	-0,81%	0,48%	2,41%	-0,50%	-2,75%	-4,30%	-22,28%
Ecart	-0,20%	-0,01%	-0,06%	-0,22%	-0,63%	-0,99%	-1,14%

Performances calendaires *

	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	2009	2008	2007
Portefeuille	-0,54%	-1,86%	-8,28%	6,27%	-4,23%	-13,75%	-	-	-	-
Indice	-0,32%	-1,65%	-8,06%	6,42%	-4,07%	-13,57%	-	-	-	-
Ecart	-0,21%	-0,21%	-0,22%	-0,15%	-0,15%	-0,18%	-	-	-	-

* 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

	1 an	3 ans	Depuis le lancement
Volatilité du portefeuille	4,16%	5,62%	5,87%
Volatilité de l'indice	4,16%	5,62%	5,88%
Tracking Error ex-post	0,04%	0,04%	0,26%
Ratio de Sharpe	-0,49	-0,30	-0,65

OBLIGATAIRE ■

Données de l'indice

Description

L'indice de stratégie Short Markit iBoxx \$ Treasuries 7-10Y, est composé de titres émis par le Trésor des Etats-Unis (maturité entre 7 et 10 ans). Il mesure la performance d'une stratégie qui consiste à inverser l'exposition à l'indice Markit iBoxx \$ Treasuries 7-10Y.

Caractéristiques

Classe d'actif : **Obligataire**
Exposition : **Amérique du Nord**
Devise de référence de l'indice : **USD**
Nombre de valeurs : 21

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
US TSY 2.25% 11/24	7,39%
US TSY 2.25% 11/25	7,36%
US TSY 2.125% 5/25	7,31%
US TSY 2% 2/25	7,29%
US TSY 2% 8/25	7,27%
US TSY 2.375% 5/27	7,06%
US TSY 2.25% 2/27	7,03%
US TSY 2.25% 8/27	7,02%
US TSY 2% 11/26	6,85%
US TSY 1.625% 2/26	6,71%
Total	71,28%

Indicateurs de l'indice

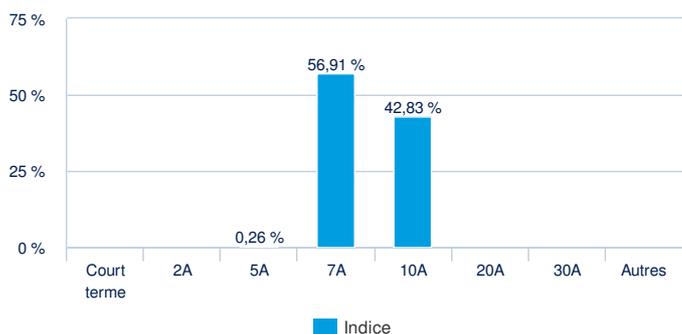
	Indice
Sensibilité	7,41
Taux de rendement	2,29%
Note moyenne	AAA

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

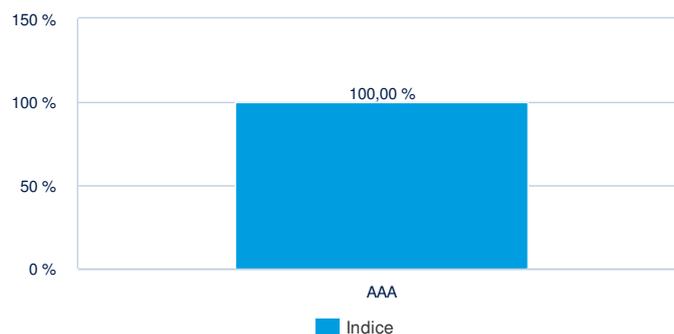
² Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition de l'indice

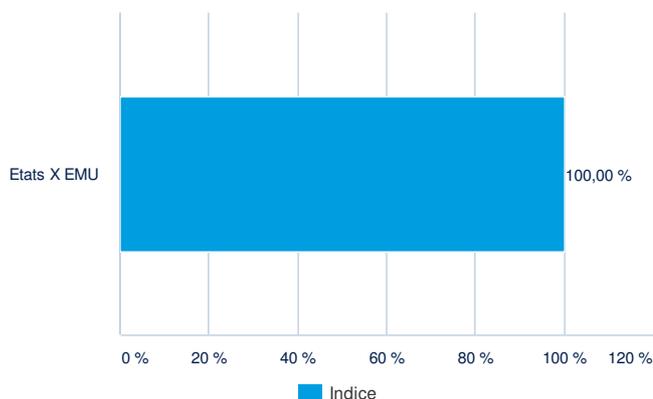
Par maturité



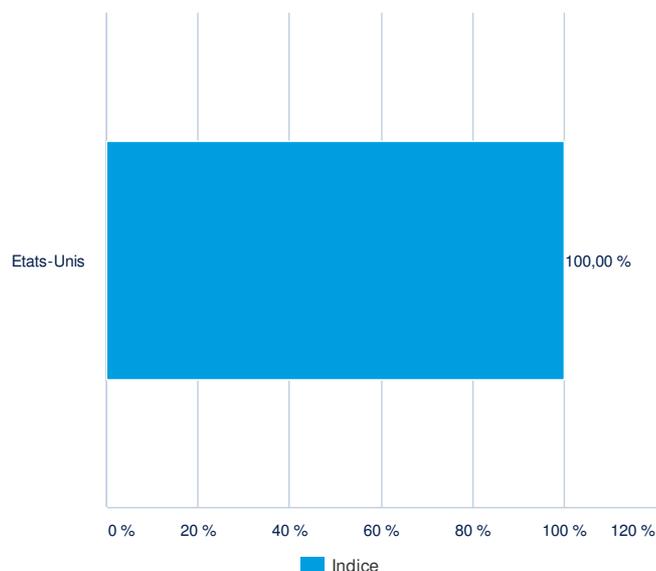
Par notation (source : Amundi)



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	17/06/2010
Devise de référence de la classe	USD
Classification de l'organisme de tutelle	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	FR0010892745
Minimum de souscription marché secondaire	1 part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,14% (prélevés) - 30/06/2017
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	-
Clôture fiscale	Juin
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	USD	SU7	SU7 FP	INSU7iNAV.PA	SU7.PA	.INSU7

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 Streng	+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.

La marque Markit iBoxx® et les indices Markit iBoxx® sont la propriété intellectuelle de International Index Company Limited et ont fait l'objet d'une licence accordée, pour certains besoins, à Amundi. Les indices Markit iBoxx® sont la propriété d'International Index Company Limited et sont utilisés sous licence. Le Fonds n'est ni approuvé, ni sponsorisé, ni recommandé par International Index Company Limited. Les indices Markit iBoxx® sont des marques déposées enregistrées d'International Index Company Limited (« le Sponsor de l'Indice ») et sont utilisées sous licence pour les Fonds concernés.

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.