

# AMUNDI USA EQUITY MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA - UCITS ETF

SYNTHESE DE  
GESTION

31/03/2018

ACTION ■

## Données clés (source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 55,19 ( USD )  
Date de VL et d'actif géré : 29/03/2018  
Actif géré : 12,14 ( millions USD )  
Code ISIN : LU1589350070  
Indice de référence :  
**100% SCIBETA UNITED STATES MULTI-BETA MULTI-STRATEGY FOUR-FACTOR ERC**

## Objectif d'investissement

Le Compartiment a pour objectif de répliquer la performance du Scientific Beta United States Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC Index, et de minimiser l'écart de suivi entre la valeur liquidative 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 %.

## 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 (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	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le
	29/12/2017	28/02/2018	29/12/2017	-	-	-	25/04/2017
<b>Portefeuille</b>	-0,19%	-0,56%	-0,19%	-	-	-	10,38%
<b>Indice</b>	-0,08%	-0,52%	-0,08%	-	-	-	10,82%
<b>Ecart</b>	-0,11%	-0,03%	-0,11%	-	-	-	-0,44%

### Performances calendaires \*

	2017	2016	2015	2014	2013
<b>Portefeuille</b>	-	-	-	-	-
<b>Indice</b>	-	-	-	-	-
<b>Ecart</b>	-	-	-	-	-

\* 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.

ACTION ■

Données de l'indice

Description

L'Indice réplique la performance de 4 sous-indices sélectionnés et pondérés parmi les indices « Scientific Beta » conçus par l'Edhec Risk Institute (ERI) sur cet univers des actions de moyennes et grandes capitalisations des marchés américains. Ces indices de stratégie croisant 4 schémas de sélection de titres et 5 stratégies dites 'Smart beta'.

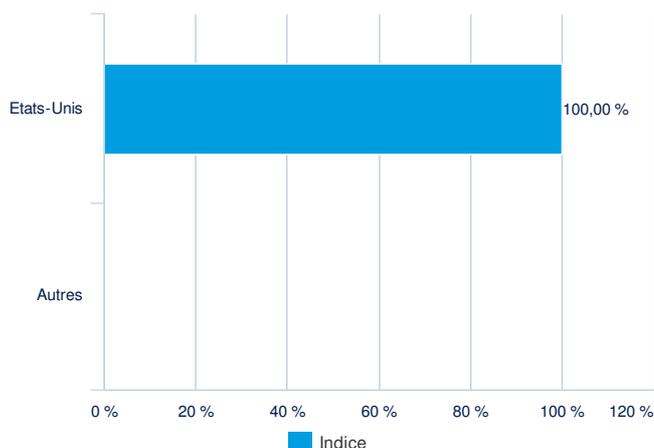
Caractéristiques

Classe d'actif : **Action**  
Exposition : **USA**  
Devise de référence de l'indice : **USD**  
Nombre de valeurs : **469**

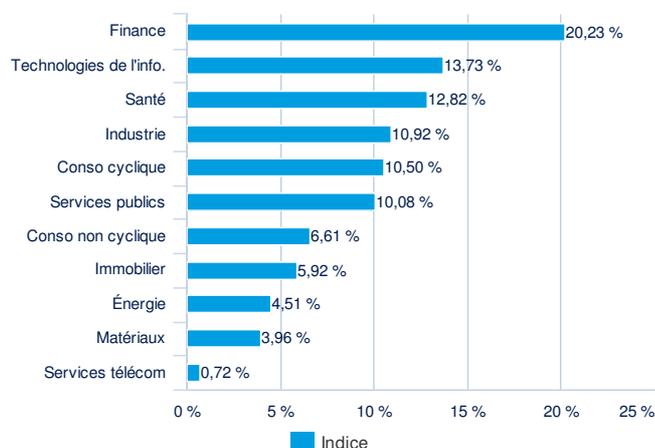
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
CME GROUP INC	0,74%
NEXTERA ENERGY INC	0,66%
XCEL ENERGY INC	0,63%
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	0,60%
REGIONS FINANCIAL	0,60%
AETNA INC	0,59%
ARCH CAPITAL GROUP	0,58%
WEC ENERGY GROUP INC	0,58%
CONS EDISON INC	0,57%
ANTHEM INC	0,57%
<b>Total</b>	<b>6,12%</b>

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Caractéristiques principales de la part

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	ERNST & YOUNG Luxembourg
Date de création de la classe	10/04/2017
Devise de référence de la classe	USD
Classification de l'organisme de tutelle	-
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1589350070
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,33 % (Estimés) - 31/01/2018
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	-
Clôture fiscale	Septembre
Teneur marché principal	BNP Paribas

## ACTION ■

## 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	SMTU	SMTU FP	ISMTU	SMTU.PA	ISMTUIINAV.PA
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	SMTU	SMTU IM	ISMTU	SMTU.MI	ISMTUIINAV.PA

## 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
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

BNP Paribas	+33 (0)1 40 14 60 01
Kepler Cheuvreux	+33 (0)1 53 65 35 25

## 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

## Fournisseurs d'indices

Type d'indice répliqué: Actions.

Le **Scientific Beta United States Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC** référencé ici est la propriété intellectuelle (y compris les marques déposées) d'EDHEC-Risk Institute Asia Ltd et/ou ses concédants et est utilisé sous licence dans le cadre de l'activité ERI Scientific Beta et en relation avec ce fonds. Le fonds qui réplique totalement ou partiellement le **Scientific Beta United States Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC** n'est ni sponsorisé, ni approuvé, ni vendu, ni recommandé par EDHEC-Risk Institute Asia Ltd et ses concédants et EDHEC-Risk Institute Asia Ltd et ses concédants déclinent toute responsabilité liée au négoce du fonds.

## 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, SPPICAV 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 les 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. 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 sous la mention SYNTHESE DE GESTION 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.