Lyxor EuroMTS 10Y Italy BTP Government Bond (DR) UCITS ETF - Acc

REPORTING

Communication Publicitaire

31/01/2024

OBLIGATAIRE ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **140,34 (EUR)**
Date de VL et d'actif géré : **31/01/2024**
Actif géré : **350,47 (millions EUR)**
Code ISIN : **LU1598691217**
Type de Réplication : **Physique**
Indice de référence :
100% FTSE EUROZONE TARGET MATURITY GOVERNMENT BOND ITALY (MID PRICE) INDEX
Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**
Date de la première VL : **02/09/2013**
VL de lancement : **100,00 (EUR)**

Objectif d'investissement

Le Lyxor EuroMTS 10Y Italy BTP Government 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 Italy 10y Target Maturity (EUR).

Indicateur de risque *(Source : Fund Admin)*

1	2	**3**	4	5	6	7

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.

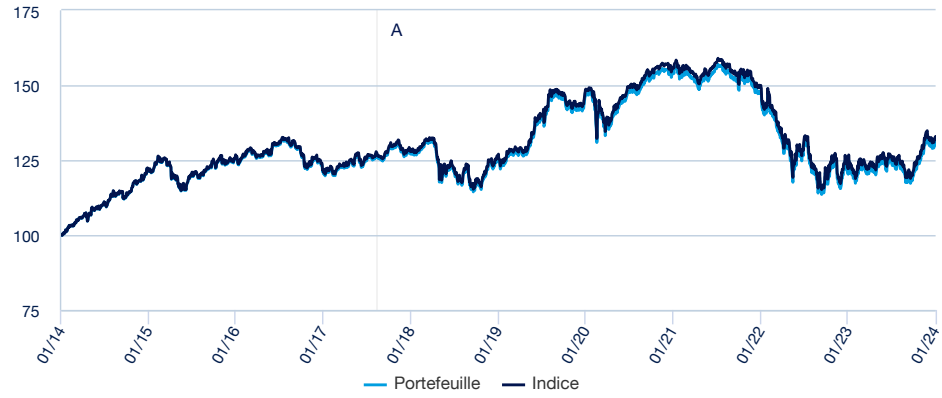
Il est important que les investisseurs potentiels évaluent les risques décrits ci-dessous et dans le prospectus du fonds, disponible sur www.lyxoretf.com

- RISQUE EN CAPITAL : Les ETF sont des instruments de réplication : leur profil de risque est similaire à celui d'un investissement direct dans l'Indice sous-jacent. Le capital des investisseurs est entièrement risqué et il se peut que ces derniers ne récupèrent pas le montant initialement investi.
- RISQUE DE REPLICATION : Les objectifs du fonds peuvent ne pas être atteints si des événements inattendus surviennent sur les marchés sous-jacents et ont un impact sur le calcul de l'indice et l'efficacité de la réplication du fonds.
- RISQUE DU SOUS-JACENT : L'Indice sous-jacent d'un ETF Lyxor peut être complexe et volatile. Dans le cas des investissements en matières premières, l'Indice sous-jacent est calculé par rapport aux contrats futures sur matières premières, ce qui expose l'investisseur à un risque de liquidité lié aux coûts, par exemple de portage et de transport. Les ETF exposés aux Marchés émergents comportent un risque de perte potentielle plus élevé que ceux qui investissent dans les Marchés développés, car ils sont exposés à de nombreux risques imprévisibles inhérents à ces marchés.
- RISQUE DE CHANGE : Les ETF peuvent être exposés au risque de change s'ils sont libellés dans une devise différente de celle de l'Indice sous-jacent qu'ils répliquent. Cela signifie que les fluctuations des taux de change peuvent avoir un impact positif ou négatif sur les rendements.
- RISQUE DE LIQUIDITE : La liquidité est fournie par des teneurs de marché enregistrés sur les bourses où les ETF sont cotés. La liquidité sur les bourses peut être limitée du fait d'une suspension du marché sous-jacent représenté par l'Indice sous-jacent suivi par l'ETF, d'une erreur des systèmes de l'une des bourses concernées, des teneurs de marché, ou d'une situation ou d'un événement exceptionnel(le).

« 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 07/09/2017, the Funds performances recorded correspond to performances of LYXOR BTP 10Y - MTS ITALY GOVERNMENT BOND (DR) UCITS ETF . This fund was absorbed by the Fund on the 07/09/2017

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Depuis le	29/12/2023	29/12/2023	31/10/2023	31/01/2023	29/01/2021	31/01/2019	31/01/2014
Portefeuille	0,22%	0,22%	9,28%	8,65%	-14,90%	4,00%	31,00%
Indice	0,23%	0,23%	9,31%	8,59%	-14,70%	4,62%	32,88%
Ecart	-0,01%	-0,01%	-0,03%	0,06%	-0,21%	-0,62%	-1,88%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	13,17%	-22,65%	-3,78%	9,52%	14,24%	-2,40%	1,44%	0,65%	4,81%	22,20%
Indice	13,11%	-22,54%	-3,63%	9,69%	14,47%	-2,22%	1,63%	0,82%	4,98%	22,34%
Ecart	0,06%	-0,11%	-0,15%	-0,17%	-0,22%	-0,18%	-0,19%	-0,18%	-0,17%	-0,14%

** 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 (Source : Fund Admin) *

	1 an	3 ans
Volatilité du portefeuille	9,48%	10,59%
Volatilité de l'indice	9,51%	10,60%
Tracking Error ex-post	0,19%	0,11%
Ratio de sharpe	0,40	-0,62

* 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.
La Tracking Error représente la volatilité annualisée des différences de performance entre l'ETF et l'indice de référence

Lyxor EuroMTS 10Y Italy BTP Government Bond (DR) UCITS ETF - Acc

REPORTING
Communication Publicitaire
31/01/2024

OBLIGATAIRE

Description de l'indice

L'indice MTS Mid Price Italy 10y Target Maturity (EUR) mesure la performance du segment des Obligations de l'Etat Italien ayant des maturités cibles à 10 ans. Il est libellé en EUR.

Données du portefeuille (Source : Amundi)

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Obligataire**
Exposition : **Italie (Zone Euro - Europe)**

Nombre de valeurs du portefeuille : **6**

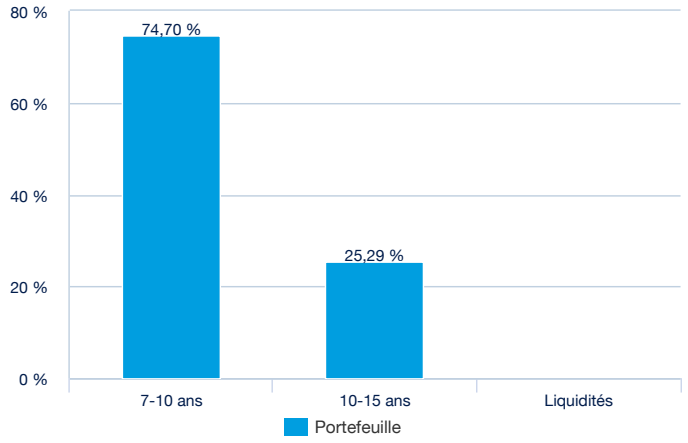
Indicateurs du portefeuille (Source : Fund Admin)

	Portefeuille
Sensibilité [1]	7,80
Notation Moyenne [2]	BBB
Taux de rendement	3,72%

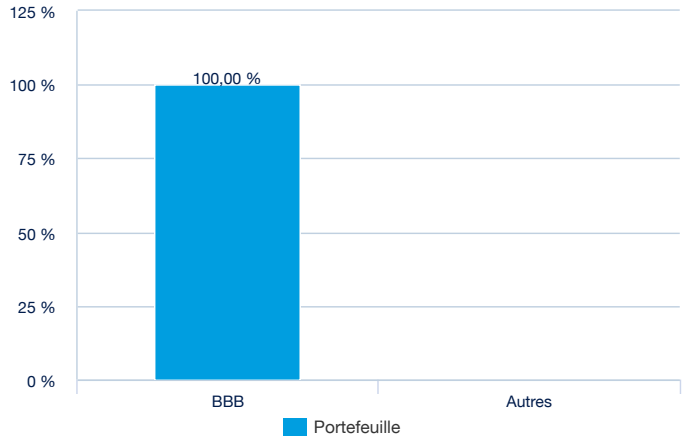
[1] La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence
[2] Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition du portefeuille (Source : Amundi)

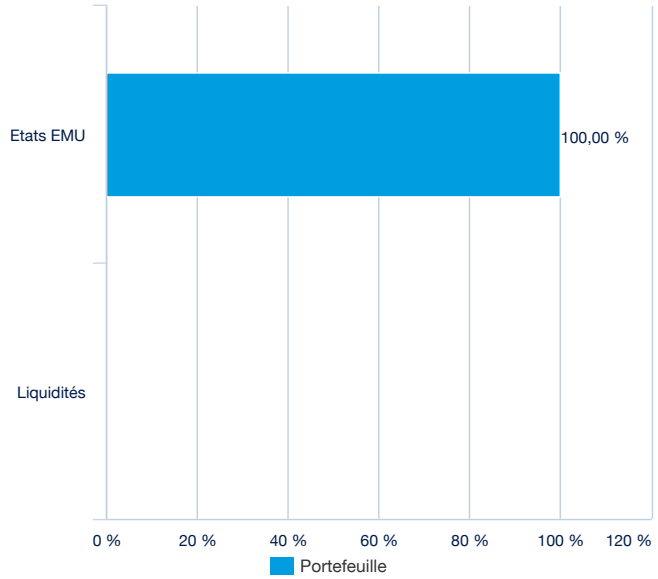
Par maturité (source : Amundi)



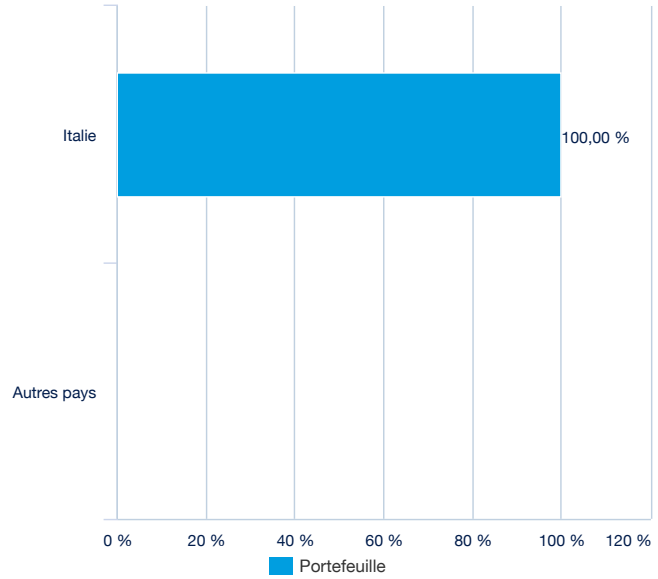
Par notation (source : Amundi)



Par type d'émetteur (source : Amundi)



Par pays (source : Amundi)



Amundi Asset Management, Société par Actions Simplifiée au capital de 1 143 615 555 €
Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF N° GP 04000036
Siège social : 91-93, boulevard Pasteur – 75015 Paris – France 437 574 452 RCS Paris

Lyxor EuroMTS 10Y Italy BTP Government Bond (DR) UCITS ETF - Acc

REPORTING

Communication Publicitaire
31/01/2024

OBLIGATAIRE

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Asset Management
Valorisateur	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Dépositaire	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Commissaire aux comptes	DELOITTE S.A., LUXEMBOURG
Date de création de la classe	07/09/2017
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1598691217
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,17% (prélevés) - 26/09/2022
Frais d'entrée (maximum)	0,10%
Frais de sortie (maximum)	0,10%
Clôture fiscale	Octobre

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	MI10	BTP10 IM	BTP10IV	BTP10.MI	BTP10IV
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	MI10	MI10 FP	BTP10IV	MI10.PA	BTP10IV

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 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 Capital Markets Amundi HK ETF

Amundi Asset Management, Société par Actions Simplifiée au capital de 1 143 615 555 €
Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF N° GP 04000036
Siège social : 91-93, boulevard Pasteur – 75015 Paris – France 437 574 452 RCS Paris

Fournisseurs d'indices

Le sous-fond n'est en aucun cas commandité, endossé, cédé ou promu par FTSE TMX Global Debt Capital Markets (ci-après collectivement appelés les "porteurs").FTSE TMX Global Debt Capital Markets ne peut être tenu responsable de la promotion ou de la commercialisation du sous-fond.FTSE MTS et les noms des indices FTSE MTS (FTSE MTS IndexTM) et FTSE MTS Indices (FTSE MTS IndicesTM) sont des marques déposées de FTSE TMX Global Debt Capital Markets. Les indices FTSE MTS sont calculés par FTSE TMX Global Debt Capital Markets et sont commercialisés et distribués par MTSNext, une filiale de FTSE TMX Global Debt Capital Markets. Ni FTSE TMX Global Debt Capital Markets ni MTSNext ne peuvent être tenus responsables de toute perte ou de tout dommage de quelque nature que ce soit (y compris, en particulier, les pertes de placement) dans connexion, en tout ou en partie, avec le sous-fond ou avec la fourniture de l'indice FTSE MTS Target Maturity Government Bond Italy (Mid Price) Index, sous-indices ou marques déposées.

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.
Lyxor EuroMTS 10Y Italy BTP Government Bond (DR) UCITS ETF 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 Lyxor EuroMTS 10Y Italy BTP Government Bond (DR) UCITS ETF 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@amundietf.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 informatique.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.lyxoretf.com.
En outre la valeur liquidative indicative figure sur les pages Reuters et Bloombergdu 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 une quelconque 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 ENVERTU 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 ETEPREALABLEMENT ENREGISTRE OU EXEMPTE D'ENREGISTREMENT EN VERTU DU U.S. SECURITIES ACT.