

AMUNDI ETF iSTOXX Europe Multi-Factor Market Neutral UCITS ETF

REPORTING

Communication
Publicitaire

28/02/2022

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **20,83 (EUR)**
 Date de VL et d'actif géré : **28/02/2022**
 Actif géré : **18,05 (millions EUR)**
 Code ISIN : **FR0013284304**
 Indice de référence :
**ISTOXX EUROPE MULTI FACTOR MARKET
 NEUTRAL**

Objectif d'investissement (Source : Amundi)

Amundi ETF iSTOXX Europe Multi-Factor Market Neutral UCITS ETF a pour objectif de répliquer au plus près l'évolution de la performance de l'indice de "stratégie" iSTOXX Europe Multi-Factor Market Neutral, à la hausse comme à la baisse, dividendes nets réinvestis, en une seule transaction. Cet ETF vise à capturer, sur le long terme, la surperformance potentielle des primes de risque du marché, indépendamment des fluctuations des marchés actions européens.

Profil de risque et de rendement (SRRI) (Source : Amundi)



⚡ 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 (DICI). La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Il n'est pas garanti et pourra évoluer dans le temps.

Performances (Source : Fund Admin)

Evolution de la performance (VL) * (Source : Fund Admin)



Indicateurs de risque (Source : Amundi)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement
Volatilité du portefeuille	3,41%	3,56%	3,47%
Volatilité de l'indice	3,40%	3,56%	3,47%
Tracking Error ex-post	0,03%	0,02%	0,02%
Ratio de Sharpe	-0,32	-0,99	-0,90

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le
	31/12/2021	31/01/2022	30/11/2021	26/02/2021	28/02/2019	-	31/10/2017
Portefeuille	0,55%	0,55%	0,29%	-0,72%	-10,75%	-	-13,84%
Indice	0,69%	0,62%	0,50%	0,15%	-8,40%	-	-10,69%
Ecart	-0,14%	-0,06%	-0,21%	-0,87%	-2,34%	-	-3,15%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017
Portefeuille	-1,07%	-5,85%	-4,89%	-5,15%	-
Indice	-0,20%	-5,01%	-4,11%	-4,43%	-
Ecart	-0,87%	-0,84%	-0,77%	-0,72%	-

* 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 ■

Rencontrez l'équipe



Lionel Brafman
Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie



Zhicong Mou
Gérant de Portefeuille - Index & Multistratégies



Pierre Maigniez
Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description

L'objectif de l'indice de stratégie iSTOXX Europe Multi-Factor Market Neutral est de s'exposer à l'écart de performance entre les indices iSTOXX Europe Multi-Factor et STOXX Europe 600 Futures Roll EUR Excess Return. Son objectif n'est donc pas de s'exposer à l'évolution des marchés actions européens. L'indice de stratégie iSTOXX Europe Multi-Factor Market Neutral pourra ainsi avoir une performance positive ou négative, indépendamment de la tendance haussière ou baissière des marchés actions européens.

L'indice de stratégie iSTOXX Europe Multi-Factor est un indice smart beta d'actions de petites, moyennes et grandes capitalisations des marchés européens développés et l'indice STOXX Europe 600 Futures Roll EUR Excess Return est un indice de contrats à termes sur l'indice actions STOXX Europe 600 qui est un indice couvrant les actions de petites, moyennes et grandes capitalisations et est pondéré par les capitalisations boursières.

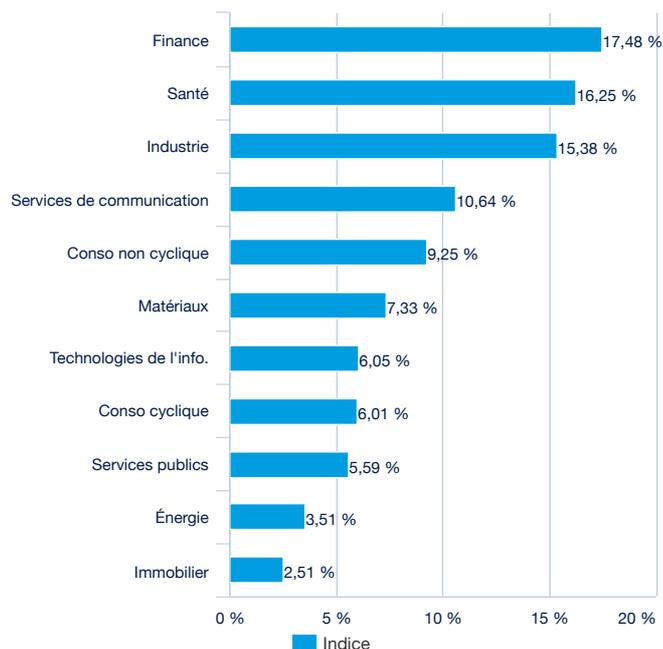
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
ROCHE HLDG AG-GENUSS	3,80%
NOVARTIS	3,23%
BANCO SANTANDER SA	2,03%
RELX PLC	2,00%
NESTLE SA-REG	1,89%
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,84%
ENGIE	1,83%
RHEINMETALL ORD	1,82%
ORANGE	1,81%
PEARSON	1,74%
Total	21,99%

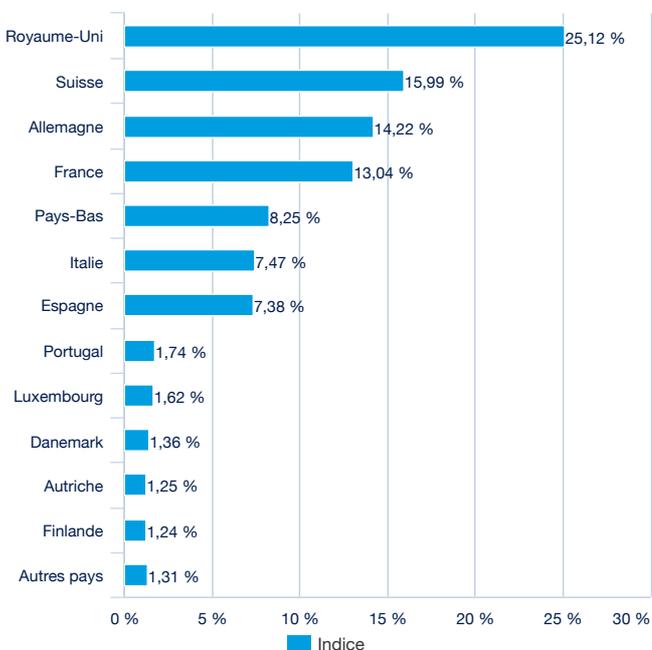
Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Action**
Exposition : **Europe**
Devise de référence de l'indice : **EUR**
Code Bloomberg de l'indice : **ISEXMETN**
Nombre de valeurs : **120**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



ACTION ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

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	31/10/2017
Date de la première VL	31/10/2017
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation et/ou Distribution
Code ISIN	FR0013284304
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,55% (prélevés) - 31/12/2021
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	-
Clôture fiscale	Décembre
Teneur marché principal	BNP Paribas

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	MKTN	MKTN FP	IMKTN	MKTN.PA	IMKTNINAV.PA
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	SMRN	SMRN GY	IMKTN	SMRN.DE	IMKTNINAV.PA
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	MKTN	MKTN IM	IMKTN	MKTN.MI	IMKTNINAV.PA

Contact

Contact ETF vente

France & Luxembourg	+33 (0)1 76 32 65 76
Allemagne & Autriche	+49 (0) 69 74 221 358
Italie	+39 02 0065 2965
Suisse (Allemand)	+41 44 588 99 36
Suisse (Français)	+41 22 316 01 51
Royaume-Uni	+44 (0) 20 7074 9321
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 Capital Market

Téléphone	+33 (0)1 76 32 19 93
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.

L'indice STOXX 50® ou les autres indices de références sont la propriété intellectuelle de Stoxx Limited, Zurich, Suisse (Les "Concédants"), et sont utilisés dans le cadre de licences. Les Concédants ne soutiennent, ne garantissent, ne vendent ni ne promeuvent en aucune façon le Fonds basé sur l'indice et déclinent toute responsabilité liée au négoce des parts du Fonds basé sur l'indice.

La description complète des indices des Concédants peut être consultée auprès de Stoxx Ltd. « EURO STOXX 50 », « STOXX 50 », « STOXX 600 », « EURO STOXX 50 Short » et « EURO STOXX 50® Leveraged » sont des marques déposées de STOXX Ltd. pour désigner les indices qu'elle calcule et qu'elle publie.

STOXX Ltd. ne garantit ni la valeur de l'indice à un moment donné, ni les résultats ou la performance du produit indexé sur cet indice.

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 garanties 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 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 SYNTHÈSE 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.