

Amundi US Treasury Bond Long Dated UCITS ETF Dist

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/08/2024

OBLIGATAIRE ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **110,36 (USD)**
 Date de VL et d'actif géré : **30/08/2024**
 Actif géré : **1 053,26 (millions USD)**
 Code ISIN : **LU1407890620**
 Type de Réplication : **Physique**
 Indice de référence :
**100% BLOOMBERG BARCLAYS US LONG
 TREASURY TOTAL RETURN INDEX VALUE**
 Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**
 Date du dernier coupon : **12/12/2023**
 Derniers Coupons par part : **3,0900 (USD)**
 Date de la première VL : **10/11/2010**
 VL de lancement : **100,00 (USD)**

Objectif d'investissement

Le Amundi US Treasury Bond 10+Y UCITS ETF Dist est un ETF (exchange traded fund) conforme à la Directive UCITS. Il a pour objectif de répliquer l'indice Bloomberg Barclays US Long Treasury Total Return Index.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 5 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.amundiETF.com

- RISQUE EN CAPITAL : Les ETF sont des instruments de réplification : 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 réplification du fonds.

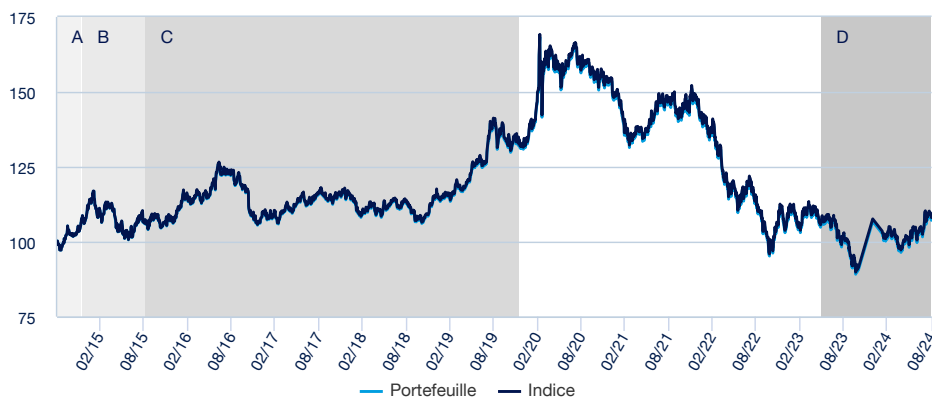
- RISQUE DU SOUS-JACENT : L'Indice sous-jacent d'un ETF Amundi peut être complexe et volatil. Dans le cas des investissements en matières premières, l'Indice sous-jacent est calculé par rapport aux contrats futures sur matières premières, ce qui expose l'investisseur à un risque de liquidité lié aux 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).

Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

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



A : Replication change from Synthetic - Unfunded to Physical - Full

B : Benchmark change from Iboxx USD Treasuries 10Y+ Total Return Index to Markit Iboxx USD Treasuries 10+ Mid Price TCA Index

C : Benchmark change from Markit Iboxx USD Treasuries 10+ Mid Price TCA Index to Bloomberg US Long Treasury Index

D : Name change from Lyxor US Treasury 10+Y (DR) UCITS ETF - Dist to Amundi US Treasury Bond 10+Y UCITS ETF Dist

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
29/12/2023	31/07/2024	31/05/2024	31/08/2023	31/08/2021	30/08/2019	29/08/2014	
Portefeuille	0,34%	2,04%	7,39%	4,83%	-26,84%	-23,45%	5,72%
Indice	0,39%	2,04%	7,43%	4,89%	-26,72%	-23,15%	6,60%
Ecart	-0,05%	0,00%	-0,03%	-0,05%	-0,12%	-0,30%	-0,88%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	3,01%	-29,30%	-4,73%	17,60%	14,02%	-1,64%	8,35%	1,12%	-1,26%	24,77%
Indice	3,06%	-29,26%	-4,65%	17,70%	14,14%	-1,56%	8,44%	1,18%	-1,13%	24,97%
Ecart	-0,05%	-0,04%	-0,09%	-0,10%	-0,12%	-0,09%	-0,09%	-0,06%	-0,12%	-0,20%

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin) *

	1 an	3 ans
Volatilité du portefeuille	15,49%	15,12%
Volatilité de l'indice	15,51%	15,13%
Tracking Error ex-post	0,06%	0,05%
Ratio de sharpe	0,04	-0,90

* 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

OBLIGATAIRE ■

* 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.

Description de l'indice

Cet indice reflète la performance des Bonds du Trésor américain ayant des maturités d'au moins 10 ans, avec un encours minimum de USD 300m.

Données du portefeuille (Source : Amundi)

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Obligataire**
Exposition : **USA**

Nombre de valeurs du portefeuille : **86**

Indicateurs du portefeuille (Source : Fund Admin)

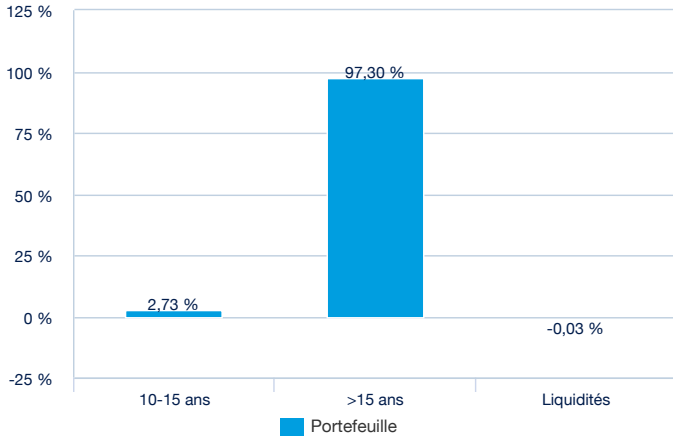
	Portefeuille
Sensibilité ¹	15,15
Note moyenne ²	AA+
Taux de rendement	4,22%

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

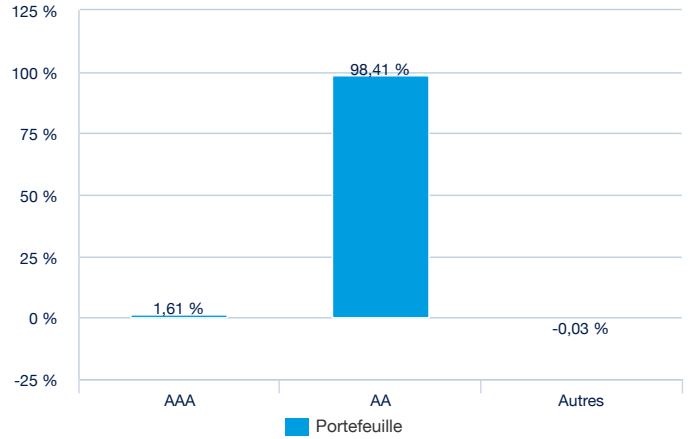
² Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition du portefeuille (Source : Amundi)

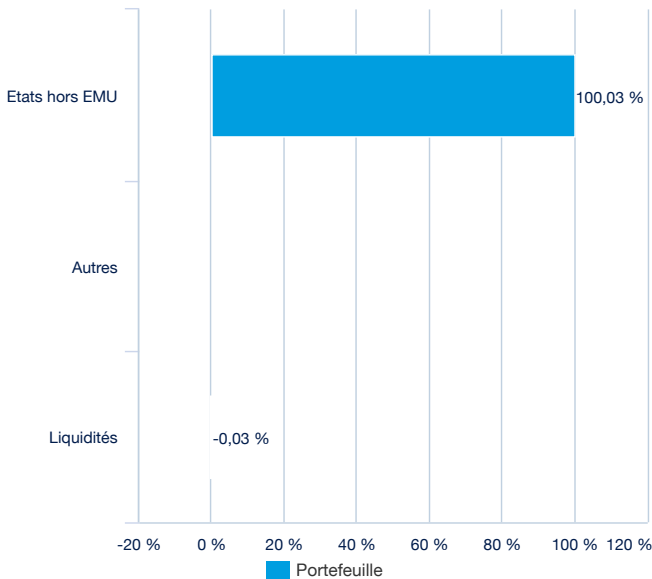
Par maturité (source : Amundi)



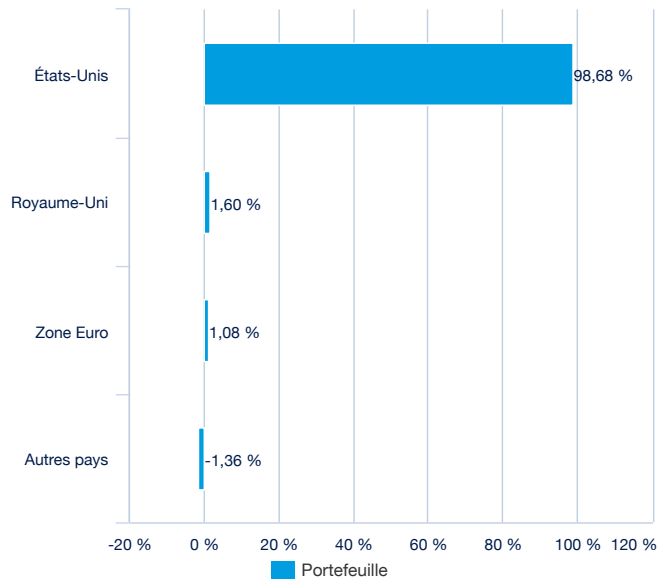
Par notation (source : Amundi)



Par type d'émetteur (source : Amundi)



Par pays (source : Amundi)



OBLIGATAIRE ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Dépositaire	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	25/10/2018
Devise de référence de la classe	USD
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Distribution
Code ISIN	LU1407890620
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation	0,06%
Frais d'entrée (maximum)	0,10%
Frais de sortie (maximum)	0,10%
Clôture fiscale	Septembre

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	9:00 - 17:30	USD	US10	US10 FP	LYUS10IV	US10.PA	LYUS10IV
London Stock Exchange	9:00 - 17:30	GBP	US10	U10G LN	U10GIV	U10G.L	U10GIV
London Stock Exchange	9:00 - 17:30	USD	US10	US10 LN	LYUS10IV	US10.L	LYUS10IV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	US10	DJAD GY	US10IV	DJAD.DE	US10IV
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	US10	US10 IM	US10IV	US10.MI	US10IV
Berne Exchange	9:00 - 17:30	USD	US10	LYUS10 BW	LYUS10IV	LYUS10.BN	LYUS10IV

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
Royaume-Uni	+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

Fournisseurs d'indices

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses sociétés affiliées (conjointement « Bloomberg »). BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc, (conjointement avec ses sociétés affiliées « Barclays »), concédée sous licence. Bloomberg ou les concédants de Bloomberg, y compris Barclays, détiennent tous les droits de propriété sur les indices Bloomberg et Barclays.

Le Compartiment n'est ni agréé, ni recommandé, ni vérifié par Bloomberg ou Barclays qui ne sont pas des sociétés affiliées à la société de gestion. Bloomberg et Barclays ne garantissent pas l'exactitude et/ou l'exhaustivité des données liées à l'Indice de référence et déclinent toute responsabilité envers la société de gestion, les investisseurs du Compartiment ou envers tout autre tiers quant à l'utilisation ou l'exactitude de l'Indice de référence ou de quelconques données incorporées dans celui-ci.

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.

Amundi US Treasury Bond Long Dated 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 Amundi US Treasury Bond Long Dated 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 (DIC).

Le DIC en langue française, ainsi que le prospectus en langue anglaise, peuvent être obtenus gratuitement sur info@amundi-etf.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.amundi-etf.com.

En outre la valeur liquidative indicative figure sur les pages Reuters et Bloomberg du 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 aucune 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 EN VERTU 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 ETE PREALABLEMENT ENREGISTRE OU EXEMPTÉ D'ENREGISTREMENT EN VERTU DU U.S. SECURITIES ACT.