

AMUNDI ETF LEVERAGED CAC 40 DAILY UCITS ETF

SYNTHESE DE
GESTION

28/02/2018

ACTION ■

Données clés (source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **187,60 (EUR)**
Date de VL et d'actif géré : **28/02/2018**
Actif géré : **18,31 (millions EUR)**
Code ISIN : **FR0010756064**
Indice de référence : **CAC 40 Leverage**

Objectif d'investissement

AMUNDI ETF LEVERAGED CAC 40 UCITS ETF a pour objectif de répliquer au plus près l'évolution de l'indice de stratégie CAC 40 Leverage®, en euro, à la hausse comme à la baisse.

Profil de risque et de rendement (SRRI)



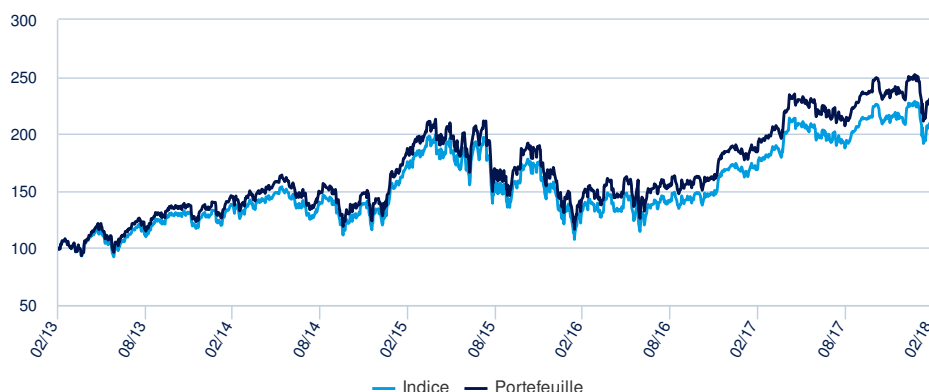
▲ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

▲ 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 (DICI). 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) *



Indicateurs de risque

	1 an	3 ans	Depuis le lancement
Volatilité du portefeuille	25,83%	33,97%	38,36%
Volatilité de l'indice	25,78%	33,98%	38,48%
Tracking Error ex-post	0,50%	0,45%	1,46%
Ratio de Sharpe	1,00	0,22	0,34

Performances glissantes *

	Depuis le 29/12/2017	1 mois 31/01/2018	3 mois 30/11/2017	1 an 28/02/2017	3 ans 27/02/2015	5 ans 28/02/2013	Depuis le 16/06/2009
Portefeuille	-0,13%	-6,08%	-2,11%	24,94%	23,60%	131,44%	192,45%
Indice	0,04%	-6,02%	-1,98%	23,88%	19,63%	110,09%	116,03%
Ecart	-0,17%	-0,06%	-0,13%	1,06%	3,97%	21,35%	76,42%

Performances calendaires *

	2017	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	2009	2008
Portefeuille	24,64%	12,04%	18,18%	1,65%	43,49%	33,04%	-33,90%	-6,38%	-	-
Indice	23,55%	10,71%	16,67%	0,30%	36,29%	24,98%	-37,82%	-12,53%	-	-
Ecart	1,09%	1,32%	1,50%	1,35%	7,20%	8,05%	3,92%	6,14%	-	-

* 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.

ACTION ■

Données de l'indice

Description

L'indice de stratégie CAC 40 Leverage® offre une double exposition à l'évolution quotidienne de l'indice CAC 40®, à la hausse comme à la baisse. C'est l'indice de référence du marché boursier français. Il est composé de 40 valeurs, choisies parmi les 100 plus importantes capitalisations boursières.

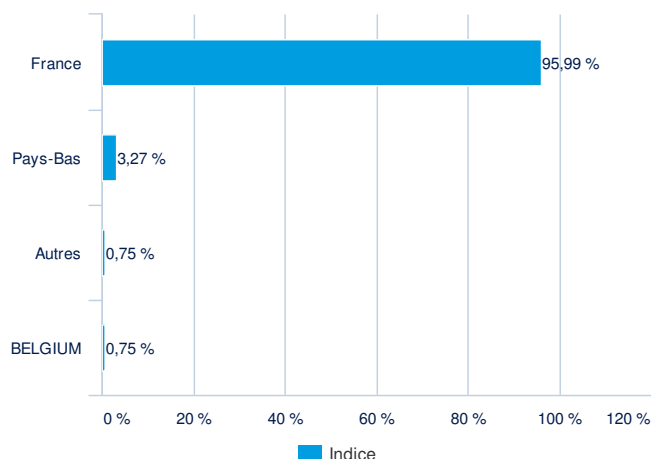
Caractéristiques

Classe d'actif : **Action**
Exposition : **Europe**
Devise de référence de l'indice : **EUR**
Nombre de valeurs : **40**

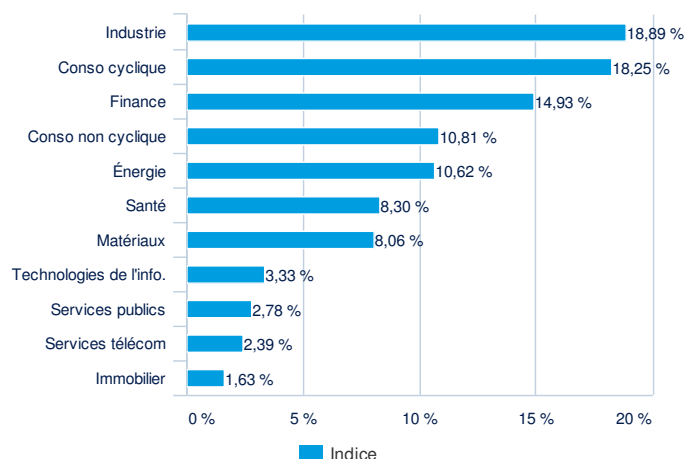
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
TOTAL	9,64%
SANOFI	6,39%
BNP PARIBAS	6,31%
LVMH MOET HENNESSY	5,91%
AIRBUS SE	4,92%
AXA	4,31%
L OREAL	3,84%
AIR LIQUIDE	3,79%
DANONE	3,64%
VINCI	3,58%
Total	52,31%

Répartition géographique



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



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	16/06/2009
Devise de référence de la classe	EUR
Classification de l'organisme de tutelle	Actions pays zone Euro
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation et/ou Distribution
Code ISIN	FR0010756064
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,30% (prélevés) - 30/06/2017
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	Eligible au PEA
Clôture fiscale	Juin
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	CL4	CL4 FP	INCL4INAV.PA	CL4.PA	.INCL4

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.

La description complète de l'indice CAC 40 peut être consultée auprès de la Société Euronext Paris SA. « CAC 40® » est une marque déposée de la Société Euronext Paris SA pour désigner l'indice qu'elle calcule et qu'elle publie.

Euronext Paris SA 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 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.