

AMUNDI ETF SHORT GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE DAILY UCITS ETF

SYNTHESE DE GESTION

30/11/2017

OBLIGATAIRE ■

Données clés (source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 79,02 (EUR)
 Date de VL et d'actif géré : 30/11/2017
 Actif géré : 43,46 (millions EUR)
 Code ISIN : FR0010821850
 Indice de référence :
 FTSE MTS Short Eurozone Government Broad IG

Objectif d'investissement

AMUNDI ETF SHORT GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF a pour objectif de répliquer au plus près l'évolution de l'indice de stratégie FTSE MTS Short Eurozone Government Broad IG, à la hausse comme à la baisse.

Cet ETF permet une exposition inverse à un portefeuille de titres émis par les gouvernements des Etats membres de la zone euro toutes maturités confondues. Ainsi, sa valeur liquidative évolue à la hausse quand l'indice EuroMTS Eurozone Government Broad All Maturities baisse et vice-versa.

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 (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) *



A : L'indice de référence est : Short EuroMTS Investment Grade Broad All Maturities

Performances glissantes *

Depuis le	Depuis le 30/12/2016	1 mois 31/10/2017	3 mois 31/08/2017	1 an 30/11/2016	3 ans 28/11/2014	5 ans 30/11/2012	Depuis le 15/12/2009
Portefeuille	-1,67%	-0,39%	-1,09%	-2,31%	-8,90%	-21,41%	-29,98%
Indice	-1,48%	-0,38%	-1,05%	-2,10%	-8,32%	-20,56%	-28,83%
Ecart	-0,19%	-0,01%	-0,04%	-0,21%	-0,58%	-0,85%	-1,15%

Performances calendaires *

	2016	2015	2014	2013	2012	2011	2010	2009	2008	2007
Portefeuille	-4,01%	-2,46%	-12,11%	-2,23%	-10,48%	-1,38%	-0,27%	-	-	-
Indice	-3,81%	-2,25%	-11,89%	-2,04%	-10,30%	-1,19%	-0,10%	-	-	-
Ecart	-0,21%	-0,21%	-0,22%	-0,19%	-0,17%	-0,19%	-0,17%	-	-	-

* 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

	1 an	3 ans	Depuis le lancement
Volatilité du portefeuille	3,54%	4,36%	4,38%
Volatilité de l'indice	3,54%	4,36%	4,37%
Tracking Error ex-post	0,03%	0,03%	0,03%
Ratio de Sharpe	-0,58	-0,63	-1,02

OBLIGATAIRE ■

Données de l'indice

Description

L'indice de stratégie FTSE MTS Short Eurozone Government Broad IG (total return – EUR) est composé de titres émis par les gouvernements des Etats membres de la zone Euro, toutes maturités confondues.

Caractéristiques

Classe d'actif : **Obligataire**
Exposition : **Zone Euro**
Devise de référence de l'indice : **EUR**
Nombre de valeurs : **298**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
OAT 4.25% 10/23	0,97%
OAT 4.5% 04/41	0,93%
OAT 5.75% 01-10/32	0,92%
OAT 3% 04/22	0,89%
OAT 3.50% 04/26	0,79%
OAT 3.75% 04/21	0,79%
OAT 3.25% 10/21	0,79%
OAT 2.75% 10/27	0,78%
OAT 5.50% 97-04/29	0,78%
BTPS 6% 05/31	0,74%
Total	8,39%

Indicateurs de l'indice

	Indice
Sensibilité	7,50
Taux de rendement	0,99%
Note moyenne	A-

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

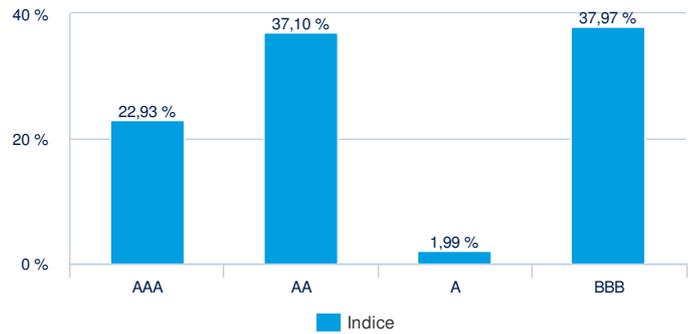
² Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition de l'indice

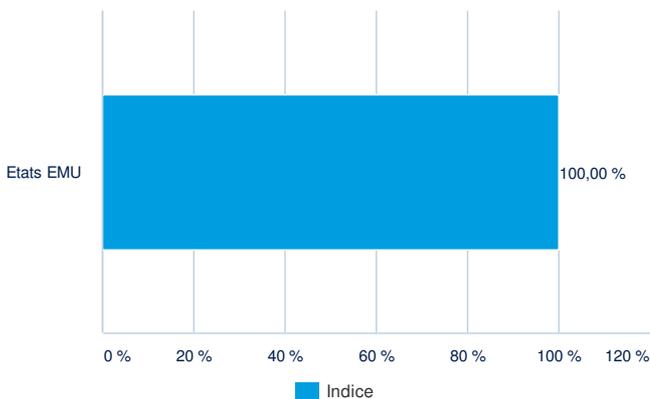
Par maturité



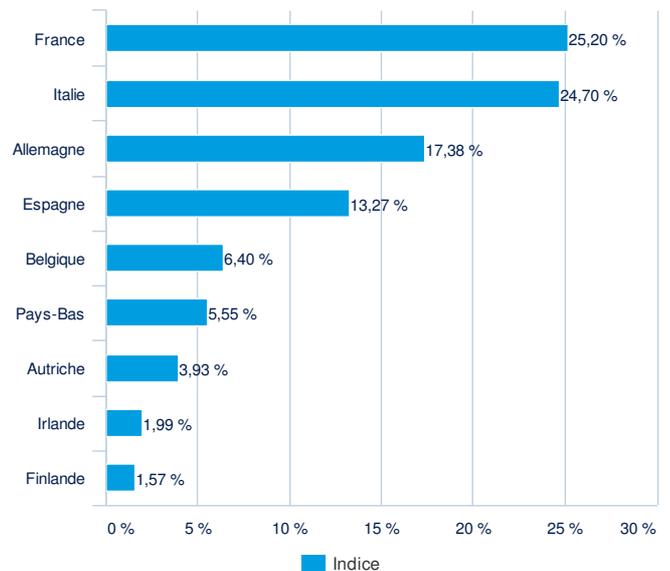
Par notation (source : Amundi)



Par type d'émetteur



Par pays (source : Amundi)



OBLIGATAIRE ■

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	15/12/2009
Devise de référence de la classe	EUR
Classification de l'organisme de tutelle	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	FR0010821850
Minimum de souscription marché secondaire	1 part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,14% (prélevés) - 31/03/2017
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Enveloppe fiscale	-
Clôture fiscale	Mars
Teneur marché principal	SGCIB

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	SB0	SB0 FP	INSB0INAV.PA	SB0.PA	.INSB0
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	540P	SB0GR GR	INSB0INAV.DE	SB0.DE	.INSB0
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	SB0	SB0 IM	INSB0INAV.MI	SB0.MI	.INSB0

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 Strengé	+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
Suisse	Ivan Durdevic	+41 (0) 44 588 99 33
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

SG CIB	+33 (0)1 42 13 38 63
BNP Paribas	+44 (0) 207 595 1844

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

OBLIGATAIRE ■

Fournisseurs d'indices

Type d'indice répliqué: Obligataire.

L'intégralité des droits relatifs à FTSE MTS (l'« Indice ») revient à MTS Next Limited. « MTS® » est une marque déposée de LSEG et est utilisée sous licence.

Le Fonds a été conçu exclusivement par AMUNDI. L'Indice est calculé par MTS Next Limited ou par son mandataire. MTS Next Limited et ses concédants de licence ne sont pas liés au Fonds et ne le commanditent pas, ne donnent pas de conseils, ne font pas de recommandations à son sujet, ne l'avalisent pas ni n'en font la promotion, et ils déclinent toute responsabilité, quelle qu'elle soit, à l'égard de toute personne découlant (a) de l'utilisation de l'Indice, de la confiance témoignée en l'Indice ou de toute erreur de l'Indice ou (b) de l'investissement dans le Fonds ou de toute opération du Fonds. MTS Next Limited et ses concédants de licence ne font aucune déclaration ou prédiction et ne donnent aucune garantie quant aux résultats devant être obtenus suite à l'utilisation du Fonds ou du caractère adéquat de l'Indice aux fins desquelles il est établi par AMUNDI.

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.