

LYXOR BUND FUTURE DAILY (-1X) INVERSE UCITS ETF

OBLIGATAIRE ■

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/12/2022

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **62,40 (EUR)**
Date de VL et d'actif géré : **30/12/2022**
Actif géré : **104,34 (millions EUR)**
Code ISIN : **LU0530119774**
Code Bloomberg : **5X62 GY**
Type de Réplication : **Synthétique**
Indice de référence :
100% SOLACTIVE BUND DAILY (-1X) INVERSE
Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**
Date du dernier coupon : **09/12/2020**
Derniers Coupons : **0,05 (EUR)**
Date de la première VL : **07/10/2010**
VL de lancement : **89,80 (EUR)**

Objectif d'investissement

Le Lyxor Bund Future Daily (-1x) Inverse UCITS ETF est un ETF (exchange traded fund) conforme à la Directive OPCVM. Il a pour objectif de répliquer l'indice Solactive Bund Daily (-1x) Inverse Index.

Les ETF Amundi sont des fonds d'investissement cotés en bourse qui procurent une exposition fidèle et bon marché à un indice de référence.

Profil de risque et de rendement (SRRI) (Source : Fund Admin)



▲ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

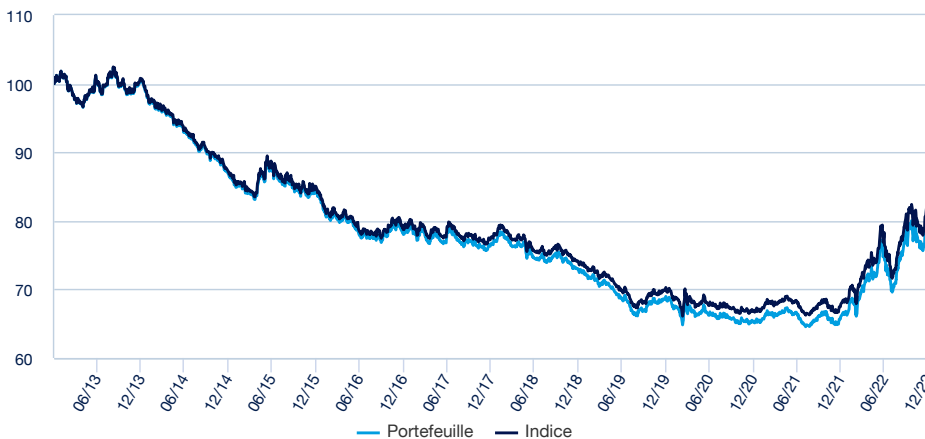
▲ A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

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.

« 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)



Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement
Volatilité du portefeuille	10,91%	7,41%	5,89%
Volatilité de l'indice	10,91%	7,41%	5,89%
Tracking Error ex-post	0,04%	0,03%	0,02%
Ratio de Sharpe	2,06	0,83	-0,46

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

	Depuis le 30/12/2021	1 mois 30/11/2022	3 mois 30/09/2022	1 an 30/12/2021	3 ans 30/12/2019	5 ans 29/12/2017	10 ans 28/12/2012
Portefeuille	22,50%	5,48%	3,58%	22,50%	17,33%	5,70%	-18,18%
Indice	22,82%	5,50%	3,64%	22,82%	18,59%	7,53%	-15,74%
Ecart	-0,31%	-0,02%	-0,06%	-0,31%	-1,27%	-1,84%	-2,45%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013
Portefeuille	22,50%	1,21%	-5,37%	-5,52%	-4,65%	-2,11%	-7,45%	-2,66%	-13,55%	1,52%
Indice	22,82%	1,53%	-4,89%	-5,20%	-4,35%	-1,79%	-7,18%	-2,46%	-13,37%	1,73%
Ecart	-0,31%	-0,32%	-0,48%	-0,32%	-0,29%	-0,32%	-0,27%	-0,20%	-0,18%	-0,21%

* 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 impactés 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.



Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

Cet indice est une stratégie répliquant la performance de Futures sur Euro-Bund. Il reflète la performance d'un investissement quotidien avec une position vendeuse sur les futures Euro-Bund plus taux d'intérêt, sur la base du Taux EONIA, sur tout capital non immobilisé. L'indice évoluera à la baisse si les taux d'intérêt des obligations à 10 ans baissent et à la hausse si les taux d'intérêt des obligations à 10 ans augmentent. L'indice reproduit approximativement un pour un la performance inversée du Bund Future sur une base quotidienne. Veuillez noter que pour des périodes de détention de plus d'une journée, la performance de l'indice short ne correspond pas à la performance inversée de l'indice de base en raison de la base de calcul journalière. Le niveau de départ de l'indice a été fixé à 100 points d'indice le 4 janvier 2010

Caractéristiques (Source : Amundi)

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

Nombre de valeurs : **2**

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme Juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	BNP PARIBAS
Dépositaire	BNP PARIBAS LUXEMBOURG
Commissaire aux comptes	ERNST & YOUNG Luxembourg
Date de création de la classe	07/10/2010
Date de la première VL	07/10/2010
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Distribution
Code ISIN	LU0530119774
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,20% (prélevés) - 26/09/2022
Clôture fiscale	Juin

Données de cotation de l'ETF (source : Amundi)

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Six Swiss Exchange	9:00 - 17:30	EUR	ETF562	CBBFSEU SW	CNAVF562	CBBUNDSEU.S	CNAVF562
Six Swiss Exchange	9:00 - 17:30	CHF	ETF562	CBBFS SW	CBBFSCIV	CBBUNDS.S	CBBFSCIV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	ETF562	5X62 GY	CNAVF562	CBBUNDS.DE	CNAVF562
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	ETF562	BUNS FP	CNAVF562	BUNS.PA	CNAVF562
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	ETF562	BUND1S IM	CNAVF562	BUND1S.MI	CNAVF562

Contact

Contact ETF vente

PAYS	N° de téléphone	E-mail	Site
Royaume-Uni	+44 (0)800-70 6956	info@lyxoretf.co.uk	www.lyxoretf.uk
Pays-Bas	+44 (0)800-70 6956	info@lyxoretf.co.uk	www.lyxoretf.nl
Autriche	+49 (0)69 717 4444	info@lyxoretf.at	www.lyxoretf.at
Allemagne	+49 (0)69 717 4444	info@lyxoretf.de	www.lyxoretf.de
Belgique	+ (0)800 - 10 880	info@lyxoretf.be	www.lyxoretf.be
Suisse	+41 (0)58 272 33 44	info@lyxoretf.ch	www.lyxoretf.ch
Danemark	+44 (0)800-707 6956	info@lyxoretf.dk	www.lyxoretf.dk
Finlande	+44 (0)800-707 6956	info@lyxoretf.fi	www.lyxoretf.fi
Espagne	+900 900 009	info@lyxoretf.es	www.lyxoretf.es
Singapour & Hong-Kong & Japon	+65 6423 2638	info@lyxoretf.com.sg	www.lyxoretf.com.sg
Italie	+800 92 93 00	info@lyxoretf.it	www.lyxoretf.it
Norvège	+44 (0)800-707 6956	info@lyxoretf.no	www.lyxoretf.no
Suède	+44 (0)800-707 6956	info@lyxoretf.se	www.lyxoretf.se
France	+(0) 33 01 42 13 96 97	info@lyxoretf.fr	www.lyxoretf.fr

Contact ETF Courtiers

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

Contact Lyxor

Lyxor ETF
91-93 bd Pasteur
CS 21564
75 730 Paris Cedex 15 - France
Hotline : +33 (0)1 42 13 42 14
Client-services-etf@lyxor.com

Fournisseurs d'indices

Solactive AG ne parraine, ne promeut, ne vend ni ne soutient d'aucune autre manière les et Solactive AG ne donne aucune garantie explicite ou implicite ou représentation des résultats découlant de l'utilisation de l'indice et/ou de l'indice Marque, la valeur de l'indice à un moment donné ou à tout autre égard. L'index est , calculé et publié par Solactive AG, qui met tout en oeuvre pour le calcul de l'index est correct. Indépendamment de leurs obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'est soumis à aucune obligation vis-à-vis de tiers, y compris des investisseurs et/ou des les intermédiaires de l'instrument financier, pour signaler les erreurs potentielles dans l'indice. La publication de l'Index par Solactive AG et octroi de licences pour l'Index et l'Index Marque de fabrique ou de commerce destinée à être utilisée dans le cadre de l'instrument financier recommandation de Solactive AG pour un investissement en capital ou contenir de quelque manière que ce soit garantie ou avis de Solactive AG concernant un investissement dans ce instrument.

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 BUND FUTURE DAILY (-1X) INVERSE 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 BUND FUTURE DAILY (-1X) INVERSE 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@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.lyxoretf.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 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 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.