

# Amundi Euro Inflation Expectations 2-10Y UCITS ETF Acc

OBLIGATAIRE ■

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/03/2024

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **113,88 (EUR)**  
Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**  
Actif géré : **254,28 (millions EUR)**  
Code ISIN : **LU1390062245**  
Type de Réplication : **Synthétique**  
Indice de référence :  
**100% MARKIT IBOXX EUR BREAKEVEN EURO-  
INFLATION FRANCE & GERMANY**  
Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**  
Date de la première VL : **13/04/2016**  
VL de lancement : **100,00 (EUR)**

## Objectif d'investissement

Le Lyxor EUR 2-10Y Inflation Expectations UCITS ETF - Acc est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence Markit iBoxx EUR Breakeven Euro-Inflation France & Germany Index Nominal TRI.

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

## Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

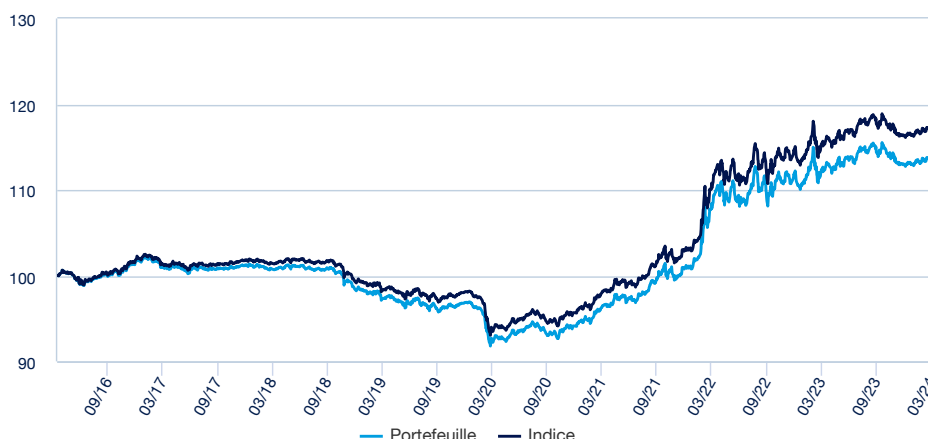
Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 3 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.

« 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 | 2,77% | 4,77% | 3,41%                 |
| Volatilité de l'indice     | 2,76% | 4,76% | 3,41%                 |
| Tracking Error ex-post     | 0,10% | 0,07% | 0,09%                 |
| Ratio de sharpe            | -0,88 | 0,92  | 0,41                  |

\* 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. L'indicateur Tracking Error mesure l'écart de rendement entre le fonds et l'indice

### Performances glissantes \* (Source : Fund Admin)

|              | Depuis le 29/12/2023 | 1 mois 29/02/2024 | 3 mois 29/12/2023 | 1 an 31/03/2023 | 3 ans 31/03/2021 | 5 ans 29/03/2019 | 10 ans - |
|--------------|----------------------|-------------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------|----------|
| Portefeuille | 0,82%                | 0,15%             | 0,82%             | 1,30%           | 18,18%           | 16,99%           | -        |
| Indice       | 0,93%                | 0,17%             | 0,93%             | 1,72%           | 19,75%           | 19,40%           | -        |
| Ecart        | -0,11%               | -0,03%            | -0,11%            | -0,42%          | -1,57%           | -2,41%           | -        |

### Performances calendaires \* (Source : Fund Admin)

|              | 2023   | 2022   | 2021   | 2020   | 2019   | 2018   | 2017   | 2016 | 2015 | 2014 |
|--------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|------|------|------|
| Portefeuille | 1,08%  | 10,69% | 7,28%  | -2,86% | -1,60% | -2,77% | -0,37% | -    | -    | -    |
| Indice       | 1,58%  | 11,14% | 7,72%  | -2,52% | -1,25% | -2,43% | -0,03% | -    | -    | -    |
| Ecart        | -0,50% | -0,45% | -0,44% | -0,35% | -0,35% | -0,34% | -0,34% | -    | -    | -    |

\* 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.

## OBLIGATAIRE

## Données de l'indice (Source : Amundi)

## Description de l'indice

L'indice est conçu de manière à fournir une exposition aux points morts d'inflation en prenant des positions longues sur les obligations indexées sur l'inflation émises par la France et l'Allemagne et courtes sur les obligations souveraines françaises et allemandes d'échéances similaires.

## Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

|                           | % d'actifs (indice) |
|---------------------------|---------------------|
| OAT IE 1.85% 07/27        | 17,20%              |
| DBRI IE 0.5% 4/30         | 14,74%              |
| DBRI IE 0.1% 4/26         | 12,34%              |
| OAT IE 3.15% 07/32        | 11,99%              |
| OAT IE 0.7% 7/30          | 11,45%              |
| OAT IE 0.1% 03/29 OATE    | 10,88%              |
| OAT IE 0.1% 03/26 OATE    | 7,77%               |
| OAT IE 0.1% 07/31 OATE    | 7,09%               |
| DBRI IE IE 0.1% 04/33 I/L | 6,54%               |
| DBR 4% 04/01/37           | -0,42%              |
| <b>Total</b>              | <b>99,58%</b>       |

## Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Obligataire**  
Exposition : **Zone Euro**

Nombre de valeurs : **26**

## Indicateurs de l'indice (Source : Fund Admin)

|                                      | Indice |
|--------------------------------------|--------|
| <b>Sensibilité <sup>1</sup></b>      | 2,97   |
| <b>Taux de rendement</b>             | 2,33%  |
| <b>Notation Moyenne <sup>2</sup></b> | AA     |

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

<sup>2</sup> Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

## Répartition de l'indice (Source : Amundi)

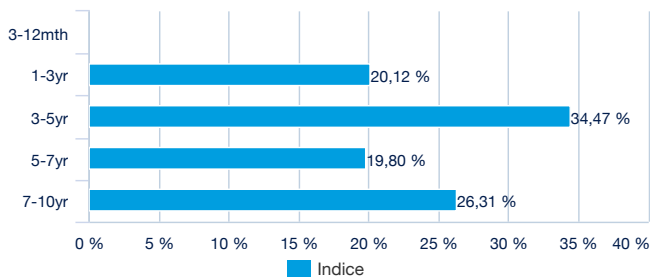
## Cinq principales valeurs (Patte Longue)

|                    | % d'actifs (indice) |
|--------------------|---------------------|
| OAT IE 1.85% 07/27 | 17,20%              |
| DBRI IE 0.5% 4/30  | 14,74%              |
| DBRI IE 0.1% 4/26  | 12,34%              |
| OAT IE 3.15% 07/32 | 11,99%              |
| OAT IE 0.7% 7/30   | 11,45%              |

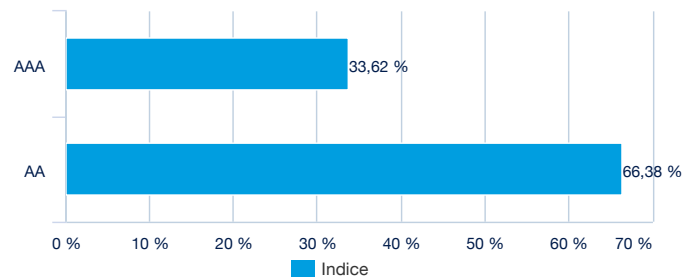
## Cinq principales valeurs (Patte Courte)

|                 | % d'actifs (indice) |
|-----------------|---------------------|
| DBR % 02/30     | 1,53%               |
| OAT 2.75% 02/29 | 0,71%               |
| OAT 0% 02/26    | 0,59%               |
| DBR 0% 08/26    | 0,58%               |
| DBR 4% 04/01/37 | 0,42%               |

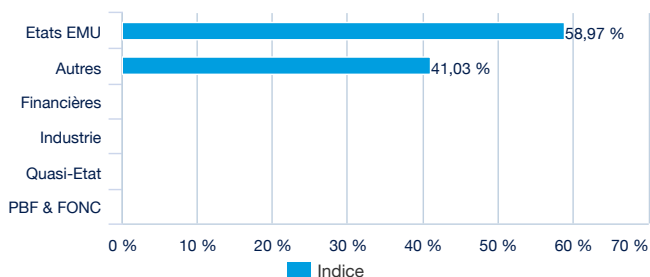
## Par maturité ETF (Patte Longue)



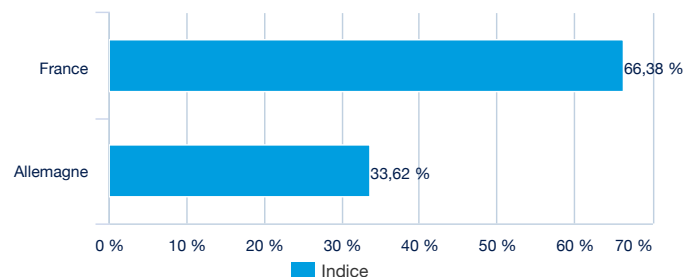
## Par notation (Patte longue)



## Par type d'émetteur (source : Amundi)



## Par pays (source : Amundi)



**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             | 13/04/2016                        |
| Date de la première VL                    | 13/04/2016                        |
| Devise de référence de la classe          | EUR                               |
| Classification AMF                        | Non applicable                    |
| Affectation des sommes distribuables      | Capitalisation                    |
| Code ISIN                                 | LU1390062245                      |
| Minimum de souscription marché secondaire | 1 Part(s)                         |
| Périodicité de calcul de la VL            | Quotidienne                       |
| Frais courants                            | 0,25% (prélevés) - 26/09/2022     |
| 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 |
|-----------------------|----------------------|--------|-------|------------------|----------------|-------------|--------------|
| Deutsche Börse        | 9:00 - 17:30         | EUR    | INFL  | EUIN GY          | INFLAIV        | EUIING.DE   | INFLAIV      |
| Six Swiss Exchange    | 9:00 - 17:30         | EUR    | INFL  | INFL SW          | INFLAIV        | INFL.S      | INFLAIV      |
| Borsa Italiana        | 9:00 - 17:30         | EUR    | INFL  | INFL IM          | INFLAIV        | INFL.MI     | INFLAIV      |
| London Stock Exchange | 9:00 - 17:30         | GBP    | INFL  | INFL LN          | INFLGBIV       | INFL.L      | INFLGBIV     |
| Nyse Euronext Paris   | 9:00 - 17:30         | EUR    | INFL  | INFL FP          | INFLAIV        | INFL.PA     | INFLAIV      |

**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      |
| UNITED KINGDOM (Retail) | +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 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

**Contact ETF Capital Market**

|                   |                                                             |
|-------------------|-------------------------------------------------------------|
| Téléphone         | +33 (0)1 76 32 19 93                                        |
| Bloomberg IB Chat | Capital Markets Amundi ETF<br>Capital Markets Amundi HK ETF |

## OBLIGATAIRE ■

## Fournisseurs d'indices

L'Indice auquel il est fait référence dans les présentes est la propriété de Markit Indices Limited. (les « Promoteurs de l'Indice ») et il est utilisé sous licence par le Compartiment. Les parties conviennent que le Compartiment n'est ni agréé ni recommandé par le Promoteur de l'Indice. En aucun cas le Promoteur de l'Indice ne fournit une quelconque garantie - expresse ou tacite (y compris, notamment, quant à la valeur commerciale ou à la pertinence pour tout usage ou utilisation spécifique) - se rapportant à l'Indice ou à toute donnée incluse ou liée à celui-ci et, en particulier, il décline toute garantie quant à la qualité, l'exactitude et/ou l'exhaustivité de l'Indice ou des données incluses ou liées à celui-ci, ou quant aux résultats obtenus par l'utilisation de l'Indice, ou à la composition de l'Indice à une date ou un moment donné, de même qu'il décline toute garantie quant à la notation financière de toute entité émettrice ou de tout crédit ou tout événement similaire (indépendamment de la définition qui lui est donnée) se rapportant à une obligation incluse dans l'Indice à une date donnée ou à tout autre moment. Le Promoteur de l'Indice ne peut être tenu responsable pour quelque raison que ce soit d'une erreur dans l'Indice et n'est pas tenu d'informer d'une telle erreur, dans le cas où elle surviendrait. En aucun cas les Promoteurs de l'Indice n'émettent une recommandation d'achat ou de vente dans le Compartiment ni n'expriment d'opinion quant à la capacité de l'Indice à reproduire la performance des marchés concernés, ou concernant l'Indice ou toute opération ou produit y relatifs, ou sur les risques y afférents. Le Promoteur de l'Indice n'est nullement tenu de prendre en considération les besoins d'un tiers lorsqu'il compile, modifie, compose ou calcule l'Indice. La responsabilité de l'acheteur ou d'un vendeur du Compartiment et des Promoteurs de l'Indice ne peut pas être engagée dans le cas où les Promoteurs de l'Indice ne prendraient pas les mesures nécessaires pour compiler, ajuster ou calculer l'Indice. Les Promoteurs de l'Indice et leurs sociétés affiliées se réservent le droit de traiter toute obligation qui compose l'Indice et peuvent, le cas échéant, accepter des dépôts, accorder des prêts ou effectuer toute autre activité de crédit, et plus généralement, exercer l'un ou la totalité des services financiers et de banque d'investissement ou toute autre activité commerciale auprès de ces émetteurs obligataires ou de leurs sociétés affiliées. En outre, ils peuvent entreprendre ces activités comme si l'Indice n'existait pas, sans tenir compte de leurs éventuelles conséquences sur l'Indice ou le Compartiment.

## 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 Euro Inflation Expectations 2-10Y 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 Euro Inflation Expectations 2-10Y 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@amundiETF.com](mailto:info@amundiETF.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.amundiETF.com](http://www.amundiETF.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.**