

Lyxor Euro Floating Rate Note UCITS ETF - Acc

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/05/2023

OBLIGATAIRE ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **101,31 (EUR)**
 Date de VL et d'actif géré : **31/05/2023**
 Actif géré : **671,23 (millions EUR)**
 Code ISIN : **LU1829218319**
 Type de Réplication : **Synthétique**
 Indice de référence :
**100% BLOOMBERG MSCI EUR CORPORATE
 LIQUID FRN 0-7 YEAR SRI SUSTAINABLE INDEX**
 Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**
 Date de la première VL : **07/01/2015**
 VL de lancement : **100,00 (EUR)**

Objectif d'investissement

Le Lyxor Euro Floating Rate Note UCITS ETF - Acc est un ETF (exchange traded fund) conforme à la directive OPCVM. Il a pour objectif de répliquer l'indice de référence Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid FRN 0-7 Year SRI Sustainable 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.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

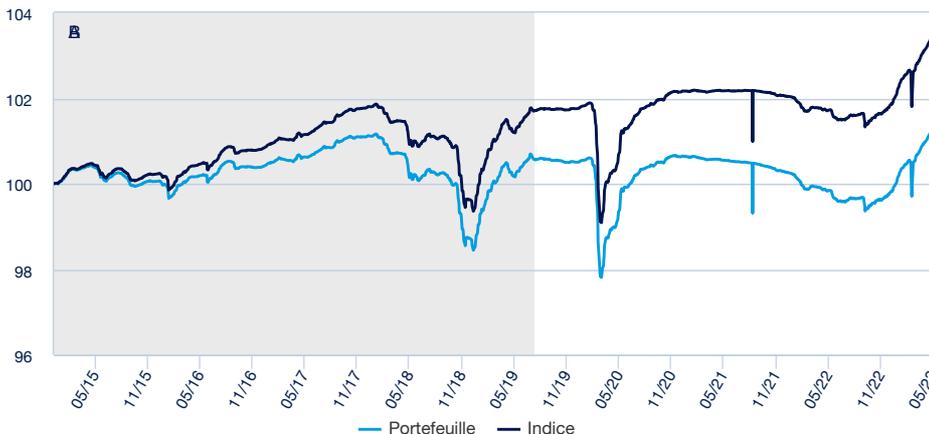
Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant plus de 1 an. 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)



A : Jusqu'au 25/10/2018, la performance du Fonds indiquée correspond à celle des compartiments de MULTI UNITS FRANCE - Lyxor Barclays Floating Rate Euro 0-7Y UCITS ETF (le Fonds absorbé). Ce dernier a été absorbé par le Fonds le 25/10/2018.

B : Jusqu'au 09/08/2019, l'Indice de référence du Fonds était Barclays Euro Corporate FRN 0-7 Year Enhanced Duration.

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
	30/12/2022	28/04/2023	28/02/2023	31/05/2022	29/05/2020	31/05/2018	-
Portfeuille	1,52%	0,35%	0,83%	1,47%	1,97%	1,15%	-
Indice	1,64%	0,37%	0,91%	1,75%	2,78%	2,54%	-
Ecart	-0,12%	-0,03%	-0,07%	-0,28%	-0,82%	-1,39%	-

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013
Portfeuille	-0,48%	-0,35%	0,12%	1,81%	-2,35%	0,71%	0,33%	-	-	-
Indice	-0,21%	-0,09%	0,38%	2,14%	-2,11%	0,96%	0,58%	-	-	-
Ecart	-0,27%	-0,26%	-0,26%	-0,33%	-0,24%	-0,25%	-0,25%	-	-	-

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement
Volatilité du portefeuille	1,25%	0,79%	0,86%
Volatilité de l'indice	1,25%	0,79%	0,86%
Tracking Error ex-post	0,01%	0,00%	0,02%
Ratio de Sharpe	0,13	0,70	0,38

* 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 garanties 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

Cet indice reflète la performance d'obligations à taux variable de qualité investment grade, libellées en euro (EUR) et émises par des entreprises européennes ou autres, avec des maturités allant de 1 mois à moins de 7 ans. Les obligations qui composent cet indice ont un coupon variable, qui s'ajuste en fonction des mouvements du 3m Euribor. L'indice exclut les émetteurs avec une notation MSCI ESG inférieure à BBB, les émetteurs impliqués dans certaines activités controversées (armes, alcool, tabac), et les émetteurs ayant un score MSCI « red flag » de controverse ESG. Pour plus d'informations concernant cet indice, veuillez consulter : www.bloomberg.com.

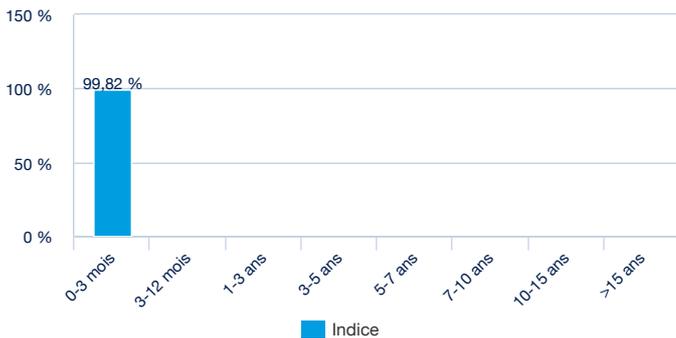
Caractéristiques (Source : Amundi)

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

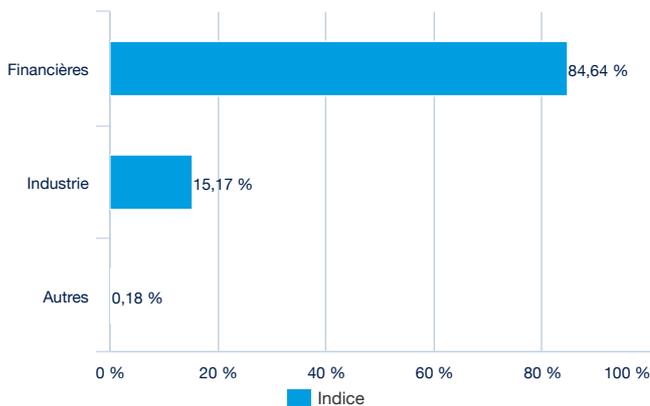
Nombre de valeurs : **62**

Répartition de l'indice (Source : Amundi)

Par maturité (source : Amundi)



Par type d'émetteur (source : Amundi)



Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
TD FRN 01/25 EMTN	5,00%
ACAFP FRN 03/25 EMTN	4,61%
CM FRN 01/24 EMTN	3,75%
ISPIM FRN 03/25 EMTN	3,75%
SOCGEN FRN 01/25 EMTN	3,32%
DAIGR FRN 03/07/24	3,30%
CS FRN 01/26 EMTN	3,20%
RY FRN 01/25 EMTN	2,95%
BAC FRN 09/26 EMTN	2,85%
BNS FRN 02/24 EMTN	2,68%
Total	35,41%

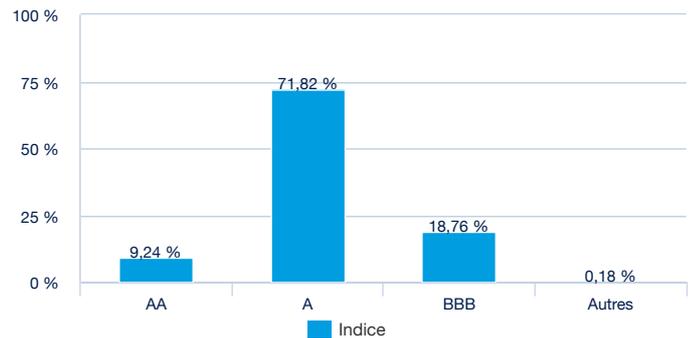
Indicateurs de l'indice (Source : Fund Admin)

	Indice
Sensibilité ¹	0,12
Taux de rendement	4,06%
Notation Moyenne ²	A-

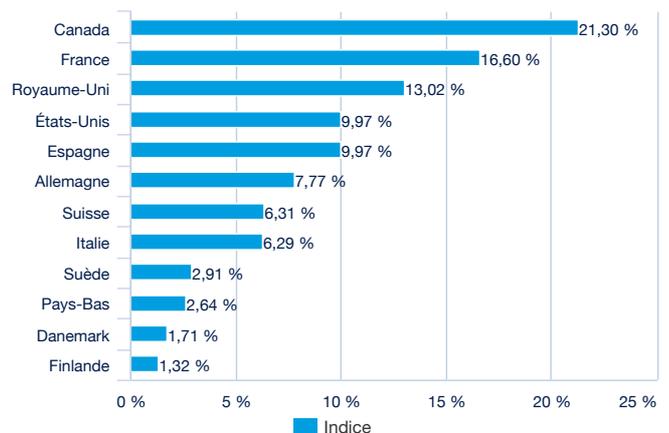
¹ La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence

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

Par notation (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 Asset Management
Valorisateur	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Dépositaire	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	25/10/2018
Date de la première VL	07/01/2015
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1829218319
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,15% (prélevés) - 26/09/2022
Clôture fiscale	Décembre

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	EUR	FLOT	FLOT FP	FLOTEUIV	FLOT.PA	FLOTEUIV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	FLOT	NK4L GY	FLOTEUIV	NK4L.DE	FLOTEUIV
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	FLOT	FLOT IM	FLOTEUIV	FLOT.MI	FLOTEUIV
Berne Exchange	9:00 - 17:30	CHF	FLOT	LFLOT BW	-	FLOT.BN	-

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 Capital Markets Amundi HK ETF

OBLIGATAIRE ■

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.

Lyxor Euro Floating Rate Note 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 Euro Floating Rate Note 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 vue 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

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 vente. 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 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 ETEPREALABLEMENT ENREGISTRE OU EXEMPTÉ D'ENREGISTREMENT EN VERTU DU U.S. SECURITIES ACT.