

Lyxor Net Zero 2050 S&P 500 Climate PAB (DR) UCITS ETF - Acc

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/10/2023

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **27,01 (USD)**
 Date de VL et d'actif géré : **31/10/2023**
 Actif géré : **2 222,53 (millions USD)**
 Code ISIN : **LU2198883410**
 Type de Réplication : **Physique**
 Indice de référence :
**100% S&P 500 NET ZERO 2050 PARIS-ALIGNED
 ESG INDEX NET TOTAL RETURN INDEX**
 Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**
 Date de la première VL : **15/07/2020**
 VL de lancement : **20,00 (USD)**

Objectif d'investissement

Le Lyxor Net Zero 2050 S&P 500 Climate PAB (DR) UCITS ETF - Acc est un ETF (exchange traded fund) conforme à la directive OPCVM. Il a pour objectif de répliquer l'indice de référence S&P 500 Net Zero 2050 Paris-Aligned ESG Net Total Return Index.

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 5 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.

Il est important que les investisseurs potentiels évaluent les risques décrits ci-dessous et dans le prospectus du fonds, disponible sur www.lyxoretf.com

- **RISQUE EN CAPITAL** : Les ETF sont des instruments de réplication : leur profil de risque est similaire à celui d'un investissement direct dans l'Indice sous-jacent. Le capital des investisseurs est entièrement risqué et il se peut que ces derniers ne récupèrent pas le montant initialement investi.

- **RISQUE DE REPLICATION** : Les objectifs du fonds peuvent ne pas être atteints si des événements inattendus surviennent sur les marchés sous-jacents et ont un impact sur le calcul de l'Indice et l'efficacité de la réplication du fonds.

- **RISQUE DU SOUS-JACENT** : L'Indice sous-jacent d'un ETF Lyxor peut être complexe et volatile. Dans le cas des investissements en matières premières, l'Indice sous-jacent est calculé par rapport aux contrats futures sur matières premières, ce qui expose l'investisseur à un risque de liquidité lié aux coûts, par exemple de portage et de transport. Les ETF exposés aux Marchés émergents comportent un risque de perte potentielle plus élevé que ceux qui investissent dans les Marchés développés, car ils sont exposés à de nombreux risques imprévisibles inhérents à ces marchés.

- **RISQUE DE CHANGE** : Les ETF peuvent être exposés au risque de change s'ils sont libellés dans une devise différente de celle de l'Indice sous-jacent qu'ils répliquent. Cela signifie que les fluctuations des taux de change peuvent avoir un impact positif ou négatif sur les rendements.

- **RISQUE DE LIQUIDITE** : La liquidité est fournie par des teneurs de marché enregistrés sur les bourses où les ETF sont cotés. La liquidité sur les bourses peut être limitée du fait d'une suspension du marché sous-jacent représenté par l'Indice sous-jacent suivi par l'ETF, d'une erreur des systèmes de l'une des bourses concernées, des teneurs de marché, ou d'une situation ou d'un événement exceptionnel(le).

« 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 11 avril 2021, l'indice de référence du Fonds était l'indice S&P 500 Paris-Aligned Climate Net Total Return.

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le 30/12/2022	1 mois 29/09/2023	3 mois 31/07/2023	1 an 31/10/2022	3 ans 30/10/2020	5 ans	10 ans
Portefeuille	12,56%	-1,98%	-8,48%	12,15%	32,13%	-	-
Indice	12,62%	-1,99%	-8,46%	12,22%	32,46%	-	-
Ecart	-0,05%	0,01%	-0,02%	-0,07%	-0,34%	-	-

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2022	2021	2020	2019	2018
Portefeuille	-21,97%	30,94%	-	-	-
Indice	-21,95%	31,11%	-	-	-
Ecart	-0,02%	-0,16%	-	-	-

* 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.

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin) *

	1 an	3 ans
Volatilité du portefeuille	15,62%	18,35%
Volatilité de l'indice	15,63%	18,36%
Tracking Error ex-post	0,04%	0,03%
Ratio de Sharpe	0,24	0,37

* 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.

La Tracking Error représente la volatilité annualisée des différences de performance entre l'ETF et l'indice de référence

ACTION ■

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

Cet indice de référence vise à représenter la performance des titres éligibles de l'indice parent S&P 500 Index. Ces titres, contribuant à la transition climatique, sont sélectionnés et pondérés pour être collectivement alignés sur le scénario de limitation du réchauffement climatique à 1,5 ° C.

Caractéristiques (Source : Amundi)

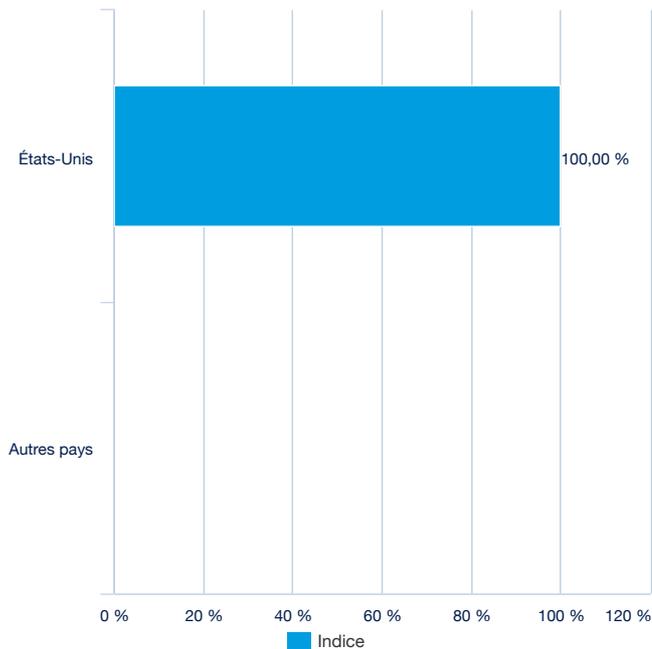
Classe d'actif : **Action**
Exposition : **USA**

Nombre de valeurs : **352**

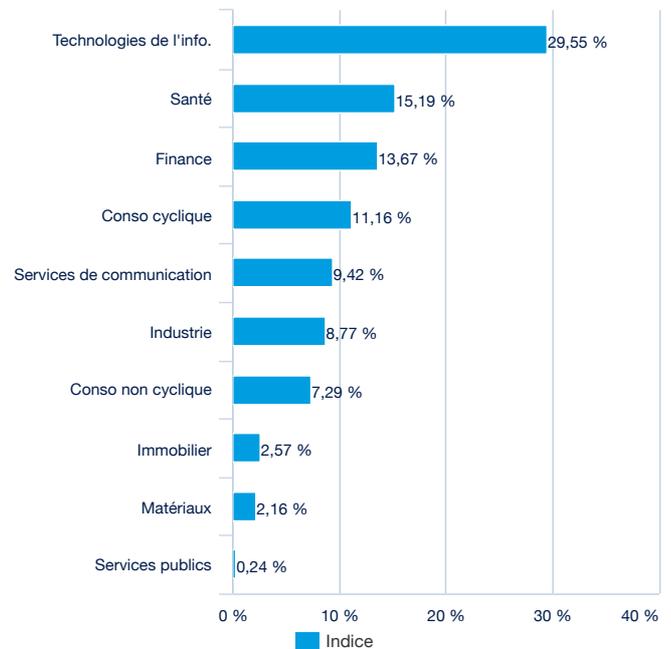
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
APPLE INC	7,07%
MICROSOFT CORP	7,02%
AMAZON.COM INC	4,54%
NVIDIA CORP	4,18%
ALPHABET INC CL A	2,67%
ALPHABET INC CL C	2,31%
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,91%
VISA INC-CLASS A SHARES	1,83%
ELI LILLY & CO	1,59%
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,59%
Total	34,72%

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



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
Six Swiss Exchange	9:00 - 17:30	CHF	ZPA5	PABU SW	PABUCHIV	PABU.S	PABUCHIV
London Stock Exchange	9:00 - 17:30	GBP	ZPA5	PABL LN	PABLGBIV	PABL.L	PABLGBIV
London Stock Exchange	9:00 - 17:30	USD	ZPA5	PABU LN	PABUUSIV	PABU.L	PABUUSIV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	ZPA5	ZPA5 GY	ZPA5EUIV	ZPA5.DE	ZPA5EUIV
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	ZPA5	PABUS IM	ZPA5EUIV	PABUS.MI	ZPA5EUIV
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	ZPA5	PABU FP	ZPA5EUIV	ZPA5.PA	ZPA5EUIV
BIVA	15:30 - 22:00	MXN	ZPA5	PABUN MM	-	PABUN.MX	-

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	15/07/2020
Devise de référence de la classe	USD
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU2198883410
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,12% (prélevés) - 26/09/2022
Frais d'entrée (maximum)	0,10%
Frais de sortie (maximum)	0,10%
Clôture fiscale	Décembre

Fournisseurs d'indices

LE COMPARTIMENT N'EST EN AUCUNE FAÇON SPONSORISÉ, AVALISÉ, VENDU OU PROMU PAR STANDARD & POOR'S OU SES AFFILIÉS (« S&P »). S&P N'ÉMET AUCUNE DÉCLARATION, CONDITION OU GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ATTENTION DES PORTEURS DE PARTS DU COMPARTIMENT OU DE TOUT MEMBRE DU PUBLIC QUANT À L'OPPORTUNITÉ D'UN INVESTISSEMENT DANS DES TITRES EN GÉNÉRAL OU DANS LE COMPARTIMENT EN PARTICULIER OU QUANT À LA CAPACITÉ DE L'INDICE S&P 500 À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU SEGMENTS DE CERTAINS MARCHÉS FINANCIERS ET/OU DE GROUPES OU CATÉGORIES D'ACTIFS.

L'UNIQUE RELATION DE S&P AVEC LA SOCIÉTÉ DE GESTION REPOSE SUR L'OCTROI SOUS LICENCE DE CERTAINES MARQUES DÉPOSÉES, NOMS COMMERCIAUX ET DE L'INDICE S&P 500, QUI EST DÉFINI, CONSTITUÉ ET CALCULÉ PAR S&P SANS TENIR COMPTE D'LA SOCIÉTÉ DE GESTION NI DU COMPARTIMENT.

S&P N'EST NULLEMENT TENUE DE PRENDRE EN COMPTE LES BESOINS D'LA SOCIÉTÉ DE GESTION LORS DE LA DÉFINITION, DE LA COMPOSITION OU DU CALCUL DE L'INDICE S&P 500. S&P N'EST RESPONSABLE NI DE LA DÉTERMINATION DES COURS ET DE LA VL DU COMPARTIMENT, NI DU CALENDRIER D'ÉMISSION/DE VENTE DE SES TITRES, PAS PLUS QUE DE LA DÉFINITION OU DU CALCUL DE L'ÉQUATION PERMETTANT LA CONVERSION EN NUMÉRIQUE DE SES ACTIONS, TOUTES ACTIVITÉS AUXQUELLES L'AGENCE NE PREND AUCUNE PART. S&P N'A AUCUNE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ QUANT À L'ADMINISTRATION, LA COMMERCIALISATION OU LA NÉGOCIATION DU COMPARTIMENT.

S&P NE GARANTIT PAS L'EXACTITUDE NI L'EXHAUSTIVITÉ DE L'INDICE S&P 500, NI DES DONNÉES Y FIGURANT, ET NE PEUT ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTE ERREUR, OMISSION OU INTERRUPTION S'Y RAPPORTANT.

S&P NE DONNE AUCUNE GARANTIE, NE POSE AUCUNE CONDITION NI NE FORMULE AUCUNE DÉCLARATION, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, QUANT AUX RÉSULTATS DEVANT ÊTRE OBTENUS PAR LA SOCIÉTÉ DE GESTION, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, ET PROVENANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE S&P 500 OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT.

S&P NE DONNE AUCUNE ESPÈCE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, Y COMPRIS CONCERNANT TOUTE QUALITÉ MARCHANDE OU ADÉQUATION À UN OBJET OU USAGE PARTICULIER, AU TITRE DE L'INDICE S&P 500 OU DES DONNÉES Y FIGURANT. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, S&P NE SAURAIT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUS DOMMAGES SPÉCIAUX, PUNITIFS, INDIRECTS OU CONSÉCUTIFS (Y COMPRIS TOUTE PERTE DE BÉNÉFICES), RÉSULTANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE S&P 500 OU DE TOUTE DONNÉE Y FIGURANT, MÊME SI ELLE A ÉTÉ AVERTIE DE LA POSSIBILITÉ DE SURVENANCE DE TELS DOMMAGES.

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 Net Zero 2050 S&P 500 Climate PAB (DR) 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 Net Zero 2050 S&P 500 Climate PAB (DR) 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 (DIC).

Le DIC 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 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 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.