

AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA - UCITS ETF DR - EUR

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Nette d'Inventaire (VNI) : **601,54 (EUR)**
Date de la VNI : **28/03/2024**
Actif géré : **37,16 (millions EUR)**
Code ISIN : **LU1602145119**
Type de Réplication : **Physique**
Indice de référence :
100% SCIENTIFIC BETA DEVELOPED MULTI-BETA MULTI-STRATEGY ERC

Objectif d'investissement

L'objectif est de répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice de stratégie Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy ERC (« l'Indice de stratégie ») quelle que soit son évolution, positive ou négative. Le Compartiment vise à atteindre un niveau d'écart de suivi du Compartiment et de son indice qui ne dépassera pas normalement 1 %.

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.

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	9,09%	12,01%	16,08%
Volatilité de l'indice	9,06%	12,00%	16,08%
Tracking Error ex-post	0,13%	0,11%	0,13%
Ratio de sharpe	1,57	0,56	0,50

* 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	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	Depuis le 14/02/2018
Portefeuille	9,28%	4,12%	9,28%	17,94%	27,19%	51,41%	66,65%
Indice	9,44%	4,17%	9,44%	18,35%	28,43%	53,70%	69,55%
Ecart	-0,17%	-0,05%	-0,17%	-0,42%	-1,24%	-2,29%	-2,90%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portefeuille	9,70%	-9,10%	28,15%	-2,51%	27,61%
Indice	9,98%	-8,79%	28,48%	-2,23%	27,95%
Ecart	-0,29%	-0,31%	-0,33%	-0,27%	-0,33%

* 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.

ACTION

Rencontrez l'équipe

**Lionel Brafman**

Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie

**Marie-Charlotte Lebigue**

Gérant de portefeuille principal

**David Heard**

Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice réplique la performance de 4 sous-indices sélectionnés et pondérés parmi les indices « Scientific Beta » conçus par l'Edhec Risk Institute (ERI) sur cet univers des actions de moyennes et grandes capitalisations des marchés développés. Ces indices de stratégie croisant 4 schémas de sélection de titres et 5 stratégies dites 'Smart beta'.

Caractéristiques (Source : Amundi)

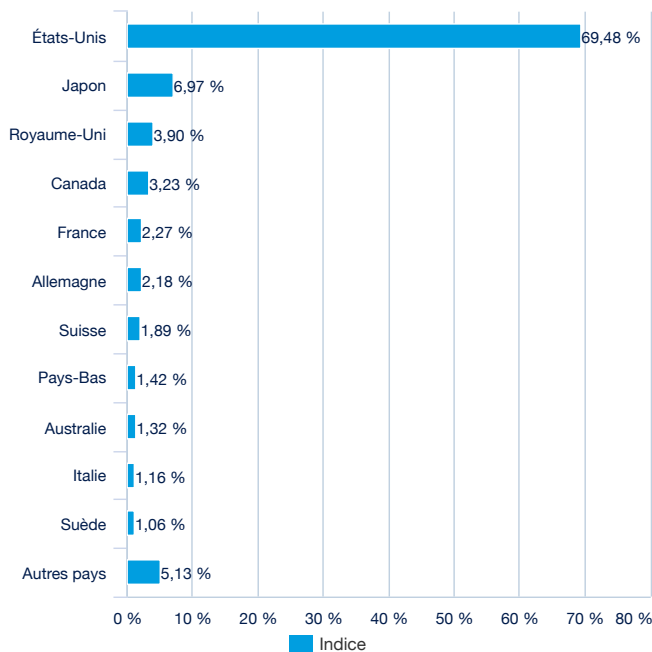
Classe d'actif : **Action**
Exposition : **International**

Nombre de valeurs : **1118**

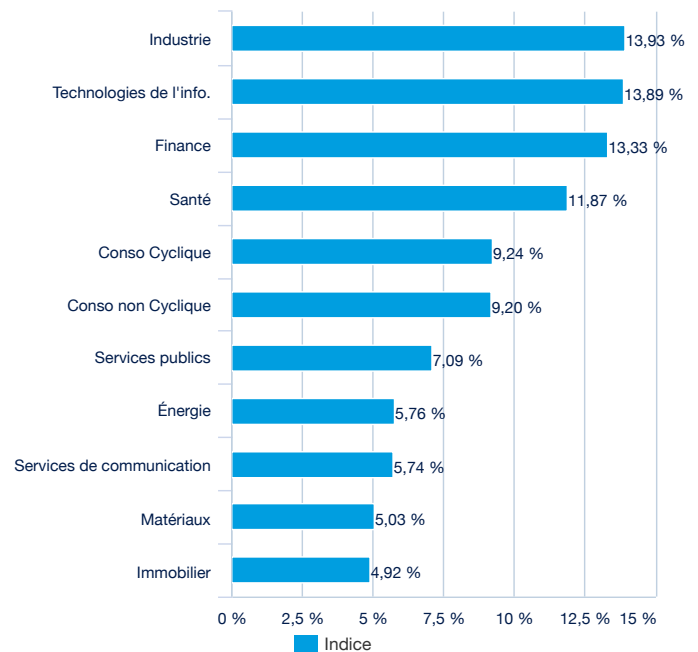
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
MERCK & CO. INC.	0,89%
VERTEX PHARMACEUTIC	0,64%
REGENERON PHARMACEUTICALS	0,52%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0,51%
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	0,50%
WALMART INC	0,49%
SYNOPSIS INC	0,49%
ALPHABET INC CL A	0,43%
EXXON MOBIL CORP	0,43%
WW GRAINGER INC	0,41%
Total	5,30%

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



ACTION ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Valorisateur	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Dépositaire	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	20/04/2017
Date de la première VL	14/02/2018
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	-
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1602145119
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VNI	Quotidienne
Frais courants	0,40% (prélevés) - 08/02/2023
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Clôture fiscale	Décembre
Teneur marché principal	BNP Paribas

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	SM8T	SM8T GY	ISMRT	SM8T.DE	ISMRTINAV.PA
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	SMRT	SMRT IM	ISMRT	SMRTA.MI	ISMRTINAV
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	EUR	SMRT	SMRT FP	ISMRT	SMRTA.PA	ISMRTINAV.PA

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 Capital Market

Téléphone	+33 (0)1 76 32 19 93
Bloomberg IB Chat	Capital Markets Amundi ETF Capital Markets Amundi HK ETF

Contact ETF Courtiers

BNP Paribas	+33 (0)1 40 14 60 01
Kepler Cheuvreux	+33 (0)1 53 65 35 25

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

ACTION ■

Fournisseurs d'indices

Type d'indice répliqué: Actions.

Le Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy ERC référencé ici est la propriété intellectuelle (y compris les marques déposées) d'EDHEC-Risk Institute Asia Ltd et/ou ses concédants et est utilisé sous licence dans le cadre de l'activité ERI Scientific Beta et en relation avec ce fonds. Le fonds qui réplique totalement ou partiellement le Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy ERC n'est ni sponsorisé, ni approuvé, ni vendu, ni recommandé par EDHEC-Risk Institute Asia Ltd et ses concédants et EDHEC-Risk Institute Asia Ltd et ses concédants déclinent toute responsabilité liée au négoce du fonds.

Avertissement

L'information contenue dans ce document est exclusivement destinée aux investisseurs institutionnels, aux investisseurs professionnels, « qualifiés » ou spécialisés et aux intermédiaires financiers. Elle n'est pas destinée à être distribuée au grand public, à la clientèle de particuliers et aux clients d'institutions financières quelle que soit la juridiction en vigueur ni aux « Ressortissants des États-Unis ». De plus, tout destinataire de l'information doit être reconnu dans l'Union européenne comme investisseur « Professionnel » tel que le définit la Directive 2004/39/CE du 21 avril 2004 sur les Marchés d'Instruments Financiers (« MIFID ») ou chaque réglementation nationale et dans le cas de la Suisse comme « Investisseur qualifié » au sens de la loi fédérale suisse en vigueur sur la distribution de placements collectifs. L'information ne peut en aucune manière être distribuée au sein de l'Union européenne à un investisseur non « Professionnel » tel que le définit la directive MIFID ou, en Suisse, à un investisseur qui ne répond pas à la définition d'« Investisseur qualifié » selon la législation et la réglementation en vigueur. Représentant : CACEIS Bank, Paris, Succursale de Nyon / Suisse, 35 route de Signy, 1260 Nyon, Suisse (anciennement « CACEIS Bank Luxembourg, Luxembourg, Succursale de Nyon », Suisse. Agent payeur : CA Indosuez (Suisse) S.A., 4 quai General Guisan, 1204 Genève.

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.