

AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI - UCITS ETF DR

OBLIGATAIRE ■

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Nette d'Inventaire (VNI) : (C) 50,34 (EUR)
(D) 45,37 (EUR)

Date de la VNI : 28/03/2024

Actif géré : 5156,19 (millions EUR)

Code ISIN : (C) LU1437018168
(D) LU1737653987

Type de Réplication : Physique

Indice de référence :
100% BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE
ESG SUSTAINABILITY SRI

Objectif d'investissement

Le Compartiment a pour objectif de répliquer la performance de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI et de minimiser l'écart de suivi entre la valeur liquidative du Compartiment et la performance de l'Indice. Le Compartiment vise à atteindre un niveau d'écart de suivi du Compartiment et de son indice qui ne dépassera normalement pas 1 %.

L'Indice est un Indice coupons réinvestis : les coupons versés par les titres de créance composant l'Indice sont inclus dans le rendement de l'Indice. L'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI est un indice obligataire représentatif des obligations d'entreprises à taux fixe de qualité « investment grade » libellées en euro qui suit les règles de l'Indice Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate (l'« Indice cadre ») et applique des critères sectoriels et ESG supplémentaires pour la sélection de titres.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



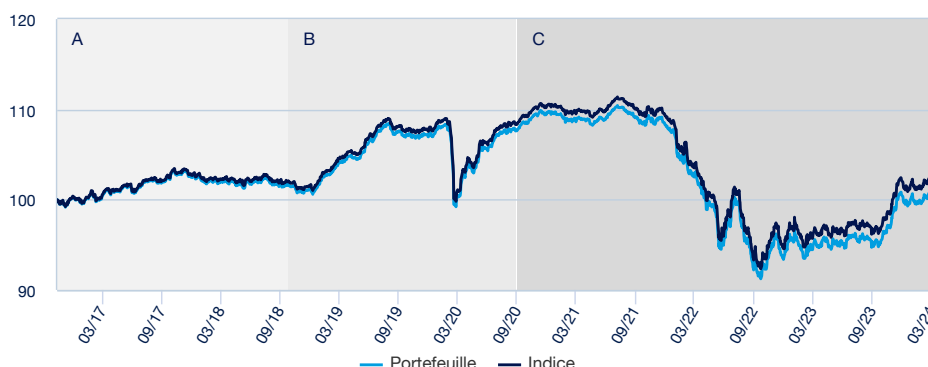
Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 4 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)



A : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment était l'indice Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Index

B : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment a été l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate SRI.

C : Depuis le début de cette période, l'indicateur de référence du compartiment est Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI

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 11/11/2016
Portefeuille	0,38%	1,20%	0,38%	6,41%	-7,23%	-3,06%	0,90%
Indice	0,41%	1,22%	0,41%	6,72%	-6,47%	-1,94%	2,55%
Ecart	-0,03%	-0,02%	-0,03%	-0,31%	-0,76%	-1,12%	-1,64%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portefeuille	7,66%	-13,78%	-1,19%	2,46%	5,84%	-1,38%	2,23%	-	-	-
Indice	7,99%	-13,48%	-0,99%	2,62%	6,02%	-1,21%	2,41%	-	-	-
Ecart	-0,33%	-0,30%	-0,20%	-0,16%	-0,18%	-0,17%	-0,19%	-	-	-

* 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.

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	3,98%	4,98%	4,08%
Volatilité de l'indice	3,98%	4,98%	4,07%
Tracking Error ex-post	0,04%	0,04%	0,05%
Ratio de sharpe	0,68	-0,77	-0,04

* 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

OBLIGATAIRE

Données du portefeuille (Source : Amundi)

Caractéristiques (Source : Amundi)

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

Nombre de valeurs du portefeuille : **2728**

Indicateurs du portefeuille (Source : Fund Admin)

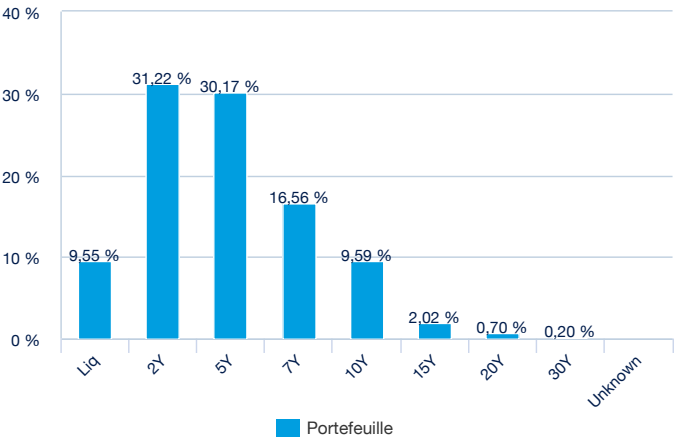
	Portefeuille
Sensibilité ¹	4,29
Notation Moyenne ²	BBB+
Taux de rendement	3,66%

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

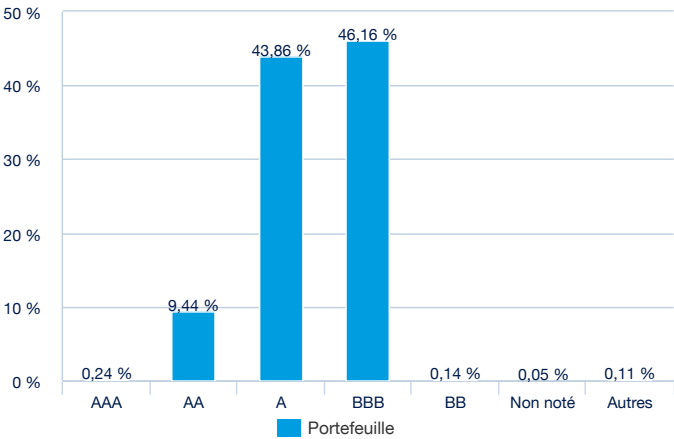
² Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition du portefeuille (Source : Amundi)

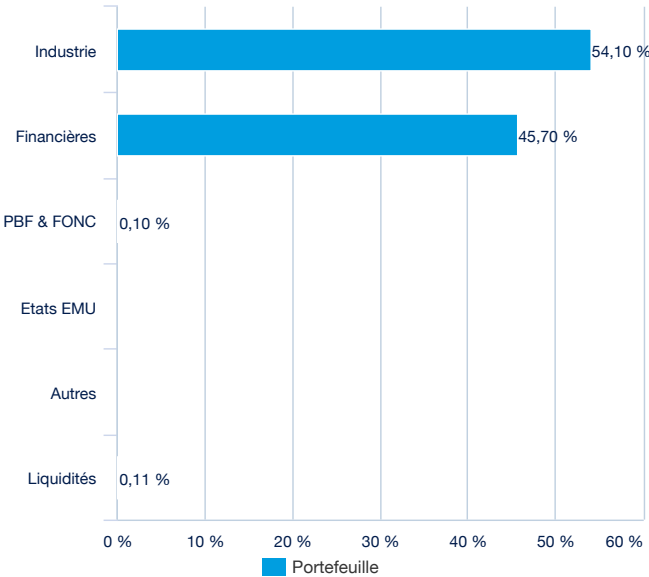
Par maturité (source : Amundi)



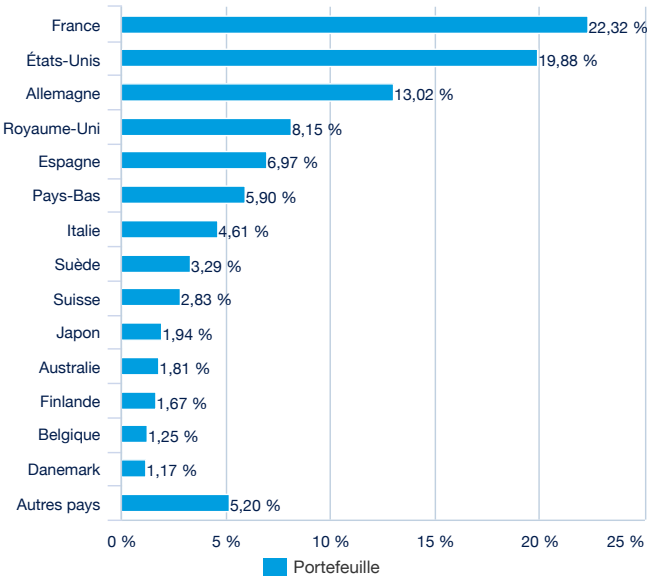
Par notation (source : Amundi)



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	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Dépositaire	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	29/06/2016
Date de la première VL	11/11/2016
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	(C) Capitalisation (D) Distribution
Code ISIN	(C) LU1437018168 (D) LU1737653987
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VNI	Quotidienne
Frais courants	0,14% (prélevés) - 08/02/2023
Durée minimum d'investissement recommandée	4 ans
Clôture fiscale	Décembre
Teneur marché principal	SGCIB

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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	ECRP	ECRP LN	-	AMNECRP.L	-
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	ECRP	ECRP IM	IECRP	ECRPI.MI	IECRPINAV.PA
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	A4H8	A4H8 GY	IECRP	A4H8.DE	IECRPINAV.PA
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	EUR	ECRP	ECRP FP	IECRP	AMECRP.PA	IECRPINAV.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

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

Fournisseurs d'indices

BLOOMBERG® est une marque déposée et une marque de service de Bloomberg Finance L.P. BARCLAYS® est une marque déposée et une marque de service de Barclays Bank Plc, utilisée sous licence. Bloomberg Finance L.P. et ses sociétés affiliées, y compris Bloomberg Index Services Limited (« BISL ») (collectivement « Bloomberg »), ou les concédants de licence de Bloomberg détiennent l'intégralité des droits de propriété de l'Indice « Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year ».

Ni Barclays Bank PLC, Barclays Capital Inc., ou toute entité affiliée (collectivement « Barclays ») ni Bloomberg ne sont l'émetteur ou le producteur d'AMUNDI INDEX EURO AGG SRI et ni Bloomberg ni Barclays n'ont de responsabilités, d'obligations ou de devoirs envers les investisseurs d'AMUNDI INDEX EURO AGG SRI. L'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year fait l'objet d'une licence d'utilisation par Amundi Asset Management en tant qu'émetteur de l'Indice AMUNDI EURO CORPORATE SRI 0-3 Y. La seule relation liant Bloomberg et Barclays à l'émetteur concernant l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year porte sur la licence de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year, qui est déterminé, composé et calculé par BISL, ou toute entité lui succédant, indépendamment de l'émetteur ou de l'Indice AMUNDI EURO CORPORATE SRI 0-3 Y ou des propriétaires de l'Indice AMUNDI INDEX EURO AGG SRI.

En outre, Amundi, Gestionnaire d'actifs d'AMUNDI INDEX EURO AGG SRI peut, en son nom, réaliser une ou plusieurs transactions avec Barclays sur ou concernant l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year en relation avec AMUNDI INDEX EURO AGG SRI. Les investisseurs acquièrent AMUNDI INDEX EURO AGG SRI de la part du Gestionnaire d'actifs Amundi, et les investisseurs n'acquièrent aucun intérêt dans Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year ; Ils ne concluent par ailleurs absolument aucune relation d'affaires avec Bloomberg ou Barclays en effectuant un investissement dans AMUNDI INDEX EURO AGG SRI. Les compartiments AMUNDI INDEX EURO AGG SRI ne sont pas sponsorisés, avalisés, vendus ou promus par Bloomberg ni par Barclays. Bloomberg et Barclays ne donnent aucune garantie, explicite ou implicite, pour ce qui est de l'intérêt d'un investissement dans le compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI ou dans des titres quelconques, ni de la capacité de répliquer d'une performance boursière correspondante/relative de la part de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year. Ni Bloomberg, ni Barclays ne s'est prononcé sur la légalité ou l'adéquation du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI en lien avec une personne ou entité quelconque. Ni, Bloomberg, ni Barclays n'est responsable ou partie prenante de la définition des prix des parts à émettre par le compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI pas plus que du calendrier ou des volumes d'émission. Ni Bloomberg, ni Barclays n'est tenu de prendre en compte les besoins de l'Émetteur, des porteurs de parts du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI ou de toute tierce partie dans le cadre de la définition, de la constitution ou du calcul de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate ESG BB+ Sustainability SRI 0-3 Year. Ni Bloomberg, ni Barclays n'a d'obligation ou de responsabilité concernant l'administration, la commercialisation ou la négociation de parts du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI.

Le contrat de licence liant Bloomberg et Barclays concerne uniquement ces derniers et aucunement les porteurs de parts du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI, les investisseurs ou d'autres tierces parties. Par ailleurs, le contrat de licence liant Amundi Asset Management et Bloomberg concerne uniquement ces derniers et aucunement les porteurs de parts du compartiment AMUNDI INDEX EURO AGG SRI, les investisseurs ou d'autres tierces parties.

NI BLOOMBERG, NI BARCLAYS NE PEUT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE ENVERS L'ÉMETTEUR, LES INVESTISSEURS OU UNE AUTRE TIERCE PARTIE DE LA QUALITÉ, DE L'EXACTITUDE ET/OU DE L'EXHAUSTIVITÉ DE L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR OU DE TOUTE DONNÉE Y FIGURANT, PAS PLUS QUE DE TOUTE INTERRUPTION DE LA COMMUNICATION DE CE-DERNIER. NI BLOOMBERG NI BARCLAYS NE GARANTIT, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, LES RÉSULTATS DEVANT ÊTRE OBTENUS PAR L'ÉMETTEUR, LES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, ET PROVENANT DE L'UTILISATION DU BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. BLOOMBERG ET BARCLAYS NE DONNENT AUCUNE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, ET DÉCLINENT EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE DE QUALITÉ MARCHANDE OU D'ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER OU D'UTILISATION EN CE QUI CONCERNE L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR OU TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. BLOOMBERG SE RÉSERVE LE DROIT DE MODIFIER SES MÉTHODES DE CALCUL OU DE PUBLICATION DE L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR COMME D'EN CESSER LE CALCUL OU LA PUBLICATION, ET NI BLOOMBERG, NI BARCLAYS NE PEUT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE DE TOUT CALCUL ERRONÉ OU DE TOUTE PUBLICATION INCORRECTE, TARDIVE OU INTERROMPUE RELATIVEMENT À L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR. NI BLOOMBERG, NI BARCLAYS NE PEUT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE DE TOUTS DOMMAGES, DIRECTS OU INDIRECTS, ET DE TOUTE PERTE DE BÉNÉFICES, MÊME SI LE RISQUE A PU EN ÊTRE ÉVOQUÉ, LIÉ À L'UTILISATION DE L'INDICE BLOOMBERG BARCLAYS MSCI EURO CORPORATE ESG BB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT OU RELATIVE AU COMPARTIMENT AMUNDI INDEX EURO AGG SRI.

L'information fournie par Bloomberg ou Barclays et figurant dans les présentes ne peut être reproduites de quelque manière que ce soit sans l'autorisation écrite préalable de Bloomberg et de Barclays Capital, division banque d'investissement de Barclays Bank PLC. Le siège social de Barclays Bank PLC (enregistrée sous le n° 1026167) est au 1, Churchill Place, Londres E14 5HP, Royaume-Uni.

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.