

# Amundi S&P 500 II UCITS ETF EUR Hedged Dist

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/03/2024

ACTION ■

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **265,05 ( EUR )**  
Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**  
Actif géré : **10 687,20 ( millions EUR )**  
Code ISIN : **LU0959211243**  
Type de Réplication : **Synthétique**  
Indice de référence :  
**100% S&P 500 EUR DAILY HEDGED**  
Date du dernier coupon : **12/12/2023**  
Derniers Coupons : **2,5000 ( EUR )**  
Date de la première VL : **19/08/2013**  
VL de lancement : **100,00 ( EUR )**

## Objectif d'investissement

Le Amundi S&P 500 II UCITS ETF EUR Hedged Dist est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence S&P 500 Net Total Return Index, compensé de l'impact des fluctuations quotidiennes de la devise de l'indice par rapport à l'EUR. La classe d'actions couverte en EUR est dotée d'un mécanisme de couverture de change quotidien simple intégré au produit d'investissement, une solution de gestion du risque de change efficace pour les investisseurs en EUR.

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 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.

« 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 | 11,52% | 16,69% | 16,42%                |
| Volatilité de l'indice     | 11,52% | 16,69% | 16,42%                |
| Tracking Error ex-post     | 0,04%  | 0,03%  | 0,03%                 |
| Ratio de sharpe            | 2,01   | 0,43   | 0,68                  |

\* 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 | 10 ans 31/03/2014 |
|--------------|----------------------|-------------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------|-------------------|
| Portefeuille | 10,09%               | 3,05%             | 10,09%            | 26,79%          | 28,79%           | 79,85%           | 174,22%           |
| Indice       | 10,06%               | 3,04%             | 10,06%            | 26,60%          | 28,15%           | 78,12%           | 168,80%           |
| Ecart        | 0,03%                | 0,01%             | 0,03%             | 0,19%           | 0,64%            | 1,73%            | 5,42%             |

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

|              | 2023   | 2022    | 2021   | 2020   | 2019   | 2018   | 2017   | 2016   | 2015  | 2014   |
|--------------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|
| Portefeuille | 22,66% | -20,58% | 27,30% | 16,84% | 27,09% | -7,48% | 19,16% | 10,07% | 0,41% | 12,74% |
| Indice       | 22,46% | -20,73% | 27,11% | 16,56% | 26,81% | -7,68% | 18,80% | 9,69%  | 0,24% | 12,80% |
| Ecart        | 0,20%  | 0,16%   | 0,18%  | 0,28%  | 0,28%  | 0,19%  | 0,37%  | 0,38%  | 0,17% | -0,06% |

Les performances des ETF de distribution sont calculées en réinvestissant les dividendes dans la performance de l'ETF

\* 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.

ACTION

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'indice S&P 500 Net Total Return Index est composé des 500 premières sociétés américaines dont les actions sont négociées sur le New York Stock Exchange ou le Nasdaq. L'indice, calculé depuis 1957, est pondéré par la capitalisation flottante. La méthodologie est disponible sur [www.indices.standardandpoors.com](http://www.indices.standardandpoors.com).

Caractéristiques (Source : Amundi)

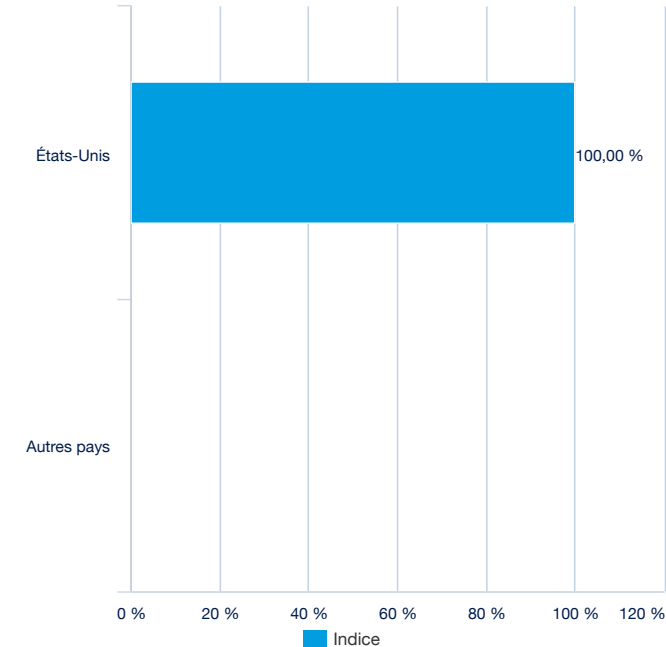
Classe d'actif : **Action**  
Exposition : **USA**

Nombre de valeurs : **503**

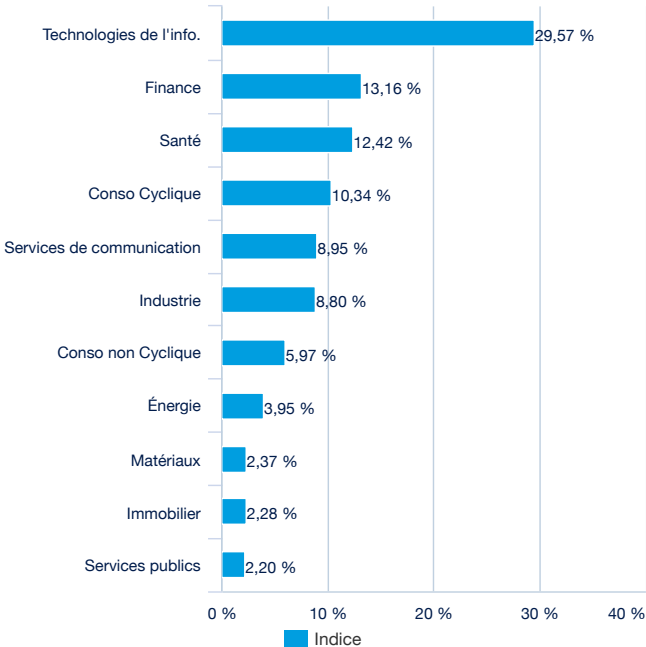
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

|                             | % d'actifs (indice) |
|-----------------------------|---------------------|
| BROADCOM INC                | 1,32%               |
| ELI LILLY & CO              | 1,41%               |
| ALPHABET INC CL C           | 1,70%               |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 1,74%               |
| ALPHABET INC CL A           | 2,02%               |
| META PLATFORMS INC-CLASS A  | 2,42%               |
| AMAZON.COM INC              | 3,74%               |
| NVIDIA CORP                 | 5,06%               |
| APPLE INC                   | 5,65%               |
| MICROSOFT CORP              | 7,09%               |
| Total                       | 32,16%              |

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                               | SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG       |
| Dépositaire                                | SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG       |
| Commissaire aux comptes                    | PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG |
| Date de création de la classe              | 19/08/2013                        |
| Date de la première VL                     | 19/08/2013                        |
| Devise de référence de la classe           | EUR                               |
| Classification AMF                         | Non applicable                    |
| Affectation des sommes distribuables       | Distribution                      |
| Code ISIN                                  | LU0959211243                      |
| Minimum de souscription marché secondaire  | 1 Part(s)                         |
| Périodicité de calcul de la VL             | Quotidienne                       |
| Frais courants                             | 0,07% (prélevés) - 02/06/2023     |
| Durée minimum d'investissement recommandée | 5 ans                             |
| Clôture fiscale                            | Septembre                         |
| Teneur marché principal                    | SOCIETE GENERALE / LANG & SCHWARZ |

## 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    | SP5H  | SP5H FP          | SP5HIV         | SP5H.PA     | SP5HIV       |
| Borsa Italiana      | 9:00 - 17:30         | EUR    | SP5H  | SPXH IM          | SP5HIV         | SPXH.MI     | SP5HIV       |
| Deutsche Börse      | 9:00 - 17:30         | EUR    | SP5H  | LYP2 GY          | SP5HIV         | LYP2.DE     | SP5HIV       |

## 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

|                  |                      |
|------------------|----------------------|
| 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](mailto: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 |

## Fournisseurs d'indices

CE 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 AMUNDI 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'AMUNDI NI DU COMPARTIMENT. S&P N'EST NULLEMENT TENUE DE PRENDRE EN COMPTE LES BESOINS D'AMUNDI 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 NUMÉRAIRE 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 AMUNDI, 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 TOUTS 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.

Amundi S&P 500 II 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 S&P 500 II 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@amundi-etf.com](mailto:info@amundi-etf.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.amundi-etf.com](http://www.amundi-etf.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 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.**

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.