

# AMUNDI S&P 500 BUYBACK UCITS ETF - EUR

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/03/2024

ACTION ■

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **277,24 ( EUR )**

Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**

Actif géré : **114,78 ( millions EUR )**

Code ISIN : **LU1681048127**

Type de Réplication : **Synthétique**

Indice de référence :

**100% S&P 500 BUYBACK NTR**

## Objectif d'investissement

Ce Compartiment est géré de manière passive.

Le Compartiment a pour objectif de répliquer la performance de l'indice S&P 500 Buyback, 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 dividendes nets réinvestis : les dividendes nets de fiscalité versés par les actions composant l'indice sont inclus dans le rendement de l'indice.

L'indice S&P 500 Buyback est un indice d'actions représentatif des 100 sociétés de premier plan composant l'indice S&P 500 et affichant le ratio de rachat le plus élevé au cours des 12 derniers mois

Pour plus d'informations sur la composition de l'indice et ses règles de fonctionnement, veuillez consulter le prospectus ou le site internet suivant : [eu.spindices.com](http://eu.spindices.com)

La valeur de l'Indice est disponible sur Reuters (SPBUYUN) et Bloomberg (SPBUYUN).

Le Compartiment aura recours à une méthode de Réplication indirecte pour obtenir une exposition à l'Indice. Le Compartiment investira dans un swap sur rendement total (instrument financier dérivé) fournissant la performance de l'Indice contre la performance des actifs détenus. Les produits dérivés font partie intégrante des stratégies d'investissement du Compartiment.

Politique de dividendes : l'action de capitalisation conserve automatiquement, et réinvestit, tous les revenus qui lui sont attribuables dans le Compartiment ; accumulant ainsi de la valeur dans le prix des actions de capitalisation.

La durée minimum d'investissement recommandée est 5 ans.

Les actions du Compartiment sont cotées et négociées sur un ou plusieurs marchés boursiers. Dans des circonstances normales, vous pouvez négocier des actions pendant les horaires d'ouverture des marchés, à condition que les Teneurs de marché puissent maintenir la liquidité du marché. Seuls les participants autorisés (par exemple les institutions financières sélectionnées) peuvent négocier des actions directement avec le Compartiment sur le marché primaire. Pour plus de détails, veuillez vous référer au prospectus de l'OPCVM.

## Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

Risque le plus élevé



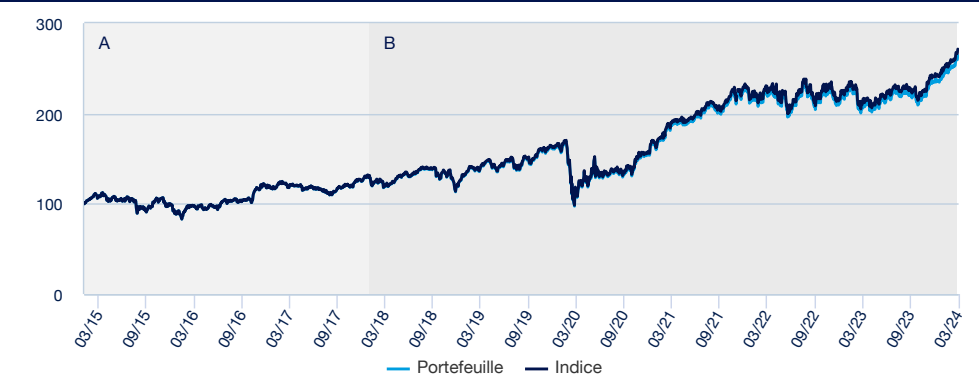
L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 5 ans.

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

ACTION

Evolution de la performance (VL) \* (Source : Fund Admin)



A : Sur la base des performances réalisées depuis la date de lancement du Fonds français « AMUNDI ETF S&P 500 BUYBACK UCITS ETF » géré par Amundi Asset Management et absorbé par « AMUNDI S&P 500 BUYBACK » le 31.01.2018.

B : Performance du Compartiment depuis la date de son lancement

Performances glissantes \* (Source : Fund Admin)

|              | Depuis le  | 1 mois     | 3 mois     | 1 an       | 3 ans      | 5 ans      | Depuis le  |
|--------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
|              | 29/12/2023 | 29/02/2024 | 29/12/2023 | 31/03/2023 | 31/03/2021 | 29/03/2019 | 03/02/2015 |
| Portefeuille | 12,47%     | 5,20%      | 12,47%     | 25,21%     | 41,36%     | 89,76%     | 164,35%    |
| Indice       | 12,58%     | 5,23%      | 12,58%     | 25,70%     | 43,06%     | 93,58%     | 171,41%    |
| Ecart        | -0,11%     | -0,03%     | -0,11%     | -0,50%     | -1,69%     | -3,82%     | -7,05%     |

Performances calendaires \* (Source : Fund Admin)

|              | 2023   | 2022   | 2021   | 2020   | 2019   | 2018   | 2017   | 2016   | 2015 | 2014 |
|--------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|------|------|
| Portefeuille | 11,30% | -6,01% | 43,89% | -2,90% | 33,44% | -3,22% | 5,94%  | 18,88% | -    | -    |
| Indice       | 11,74% | -5,64% | 44,47% | -2,51% | 33,98% | -2,97% | 6,14%  | 18,94% | -    | -    |
| Ecart        | -0,44% | -0,37% | -0,58% | -0,39% | -0,53% | -0,26% | -0,20% | -0,06% | -    | -    |

\* 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.

Rencontrez l'équipe



**Lionel Brafman**  
Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie



**Zhicong Mou**  
Gérant de Portefeuille - Index & Multistratégies



**Pierre Maigniez**  
Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'indice S&P 500 Buyback est un indice d'actions représentatif des 100 sociétés de premier plan de l'indice S&P 500 ayant le ratio de rachat d'actions le plus élevé au cours des 12 derniers mois.

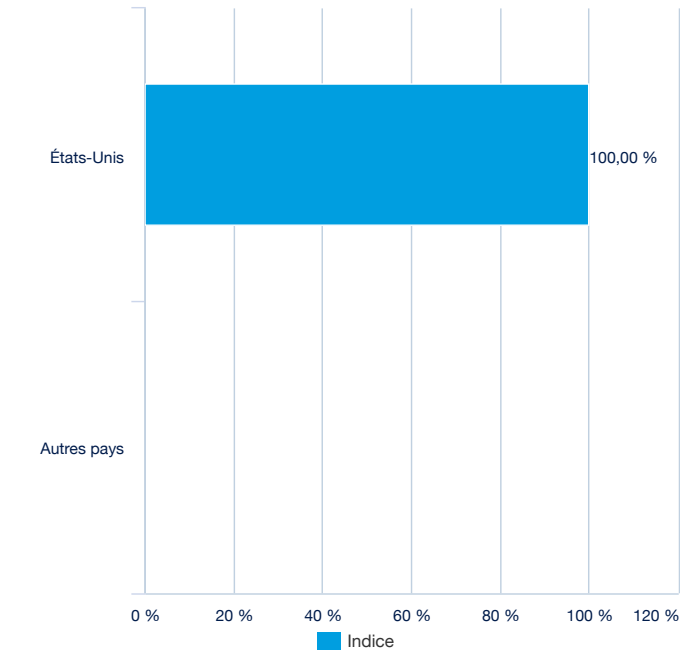
Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Action**  
Exposition : **Amérique du Nord**  
Devise de référence de l'indice : **USD**  
Nombre de valeurs : **100**

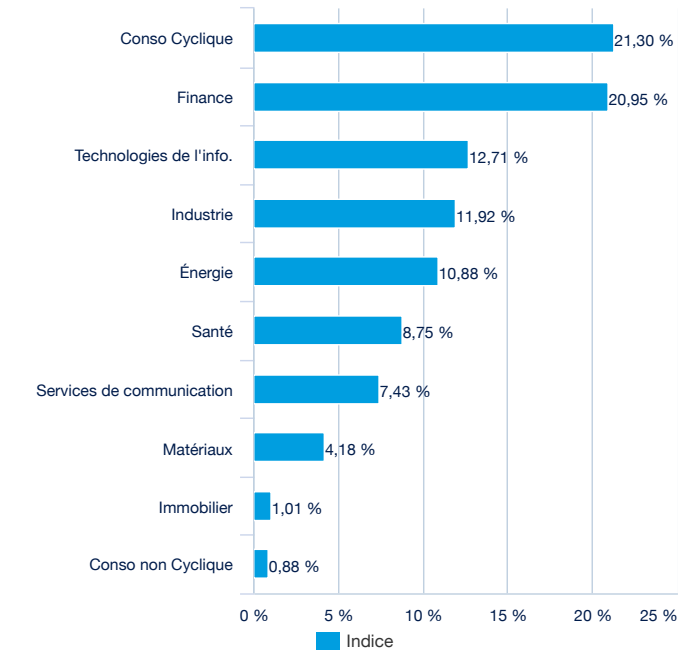
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

|                            | % d'actifs (indice) |
|----------------------------|---------------------|
| VALERO ENERGY CORP         | 1,23%               |
| MARATHON PETROLEUM CORP    | 1,19%               |
| STEEL DYNAMICS INC.        | 1,18%               |
| UNITED RENTALS             | 1,18%               |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 1,18%               |
| DIAMONDBACK ENERGY INC     | 1,18%               |
| RALPH LAUREN               | 1,18%               |
| LAM RESEARCH CORP          | 1,17%               |
| TAPESTRY INC               | 1,14%               |
| PHILLIPS 66                | 1,14%               |
| <b>Total</b>               | <b>11,78%</b>       |

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (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              | 31/01/2018                        |
| Date de la première VL                     | 03/02/2015                        |
| Devise de référence de la classe           | EUR                               |
| Classification AMF                         | -                                 |
| Affectation des sommes distribuables       | Capitalisation                    |
| Code ISIN                                  | LU1681048127                      |
| Minimum de souscription marché secondaire  | 1 Part(s)                         |
| Périodicité de calcul de la VL             | Quotidienne                       |
| Frais courants                             | 0,15% ( 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 |
|---------------------|----------------------|--------|-------|------------------|----------------|-------------|--------------|
| Borsa Italiana      | 9:00 - 17:30         | EUR    | B500  | B500 IM          | IBYBE          | B500.MI     | IBYBEINAV.PA |
| Deutsche Börse      | 9:00 - 17:30         | EUR    | B500  | B500 GY          | IBYBE          | B500.DE     | IBYBEINAV.PA |
| Nyse Euronext Paris | 9:05 - 17:35         | EUR    | BYBE  | BYBE FP          | IBYBE          | BYBE.PA     | IBYBEINAV.PA |

Contact

## ACTION ■

## 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 (Insti)  | +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<br>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

## Fournisseurs d'indices

LE COMPARTIMENT AMUNDI S&P 500 BUYBACK 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

Ce document est fourni à titre d'information seulement et il ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation ou une offre, un conseil ou une invitation d'achat ou de vente des parts ou actions des FCP, FCPE, SICAV, compartiment de SICAV, SPICAV présentés dans ce document (« les OPC ») et ne doit en aucun cas être interprété comme tel. Ce document ne constitue pas la base d'un contrat ou d'un engagement de quelque nature que ce soit. Toutes les informations contenues dans ce document peuvent être modifiées sans préavis. La société de gestion n'accepte aucune responsabilité, directe ou indirecte, qui pourrait résulter de l'utilisation de toutes informations contenues dans ce document. La société de gestion ne peut en aucun cas être tenue responsable pour toute décision prise sur la base de ces informations. Les informations contenues dans ce document vous sont communiquées sur une base confidentielle et ne doivent être ni copiées, ni reproduites, ni modifiées, ni traduites, ni distribuées sans l'accord écrit préalable de la société de gestion, à aucune personne tierce ou dans aucun pays où cette distribution ou cette utilisation serait contraire aux dispositions légales et réglementaires ou imposerait à la société de gestion ou à ses fonds de se conformer aux obligations d'enregistrement auprès des autorités de tutelle de ces pays. Tous les OPC ne sont pas systématiquement enregistrés dans le pays de juridiction de tous les investisseurs. Investir implique des risques : les performances passées des OPC présentées dans ce document ainsi que les simulations réalisées sur la base de ces dernières, ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne préjugent pas des performances futures de ces derniers. Les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. Les prospectus complets des OPC de droit français visés par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sont disponibles gratuitement sur simple demande au siège social de la société de gestion. Concernant les mandats de gestion, ce document fait partie du relevé des activités de gestion de votre portefeuille et doit être lu conjointement avec tout autre relevé périodique ou avis de confirmation relatif aux opérations de votre portefeuille, fourni par votre teneur de compte. La source des données du présent document est la société de gestion sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.

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.