

Lyxor Global High Yield Sustainable Exposure UCITS ETF - Acc

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

OBLIGATAIRE ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **21,13 (USD)**
 Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**
 Actif géré : **54,93 (millions USD)**
 Code ISIN : **LU2099295466**
 Type de Réplication : **Synthétique**
 Indice de référence :
**100% BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE
 HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE**
 Date de la première VL : **16/01/2020**
 VL de lancement : **20,00 (USD)**

Objectif d'investissement

Le Lyxor Global High Yield Sustainable Exposure UCITS ETF - Acc est un ETF (Exchange Traded Fund) conforme à la Directive UCITS. Il a pour objectif de répliquer, à la hausse comme à la baisse, l'indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable.

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 3 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 | 6,13% | 7,48% | 10,21% |
| Volatilité de l'indice | 6,12% | 7,45% | 10,19% |
| Tracking Error ex-post | 0,01% | 1,30% | 1,10% |
| Ratio de sharpe | 0,57 | -0,49 | -0,08 |

* 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 | 10 ans |
|--------------------|----------------------|-------------------|-------------------|-----------------|------------------|-------|--------|
| Portfeuille | 0,23% | 1,02% | 0,23% | 9,12% | -1,82% | - | - |
| Indice | 0,35% | 1,06% | 0,35% | 9,59% | -0,54% | - | - |
| Ecart | -0,11% | -0,04% | -0,11% | -0,47% | -1,28% | - | - |

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

| | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 |
|--------------------|--------|---------|--------|------|------|
| Portfeuille | 12,37% | -13,58% | 0,88% | - | - |
| Indice | 12,86% | -13,21% | 1,31% | - | - |
| Ecart | -0,49% | -0,37% | -0,43% | - | - |

* 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 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.

OBLIGATAIRE ■

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

Cet indice représente la performance du marché des obligations à haut rendement globales, avec des maturités d'au moins un an. Il inclut uniquement des émetteurs avec une notation ESG égale ou supérieure à BBB d'après MSCI et exclut les émetteurs liés à certains secteurs tels que les activités liées aux armes militaires controversées ainsi que les sociétés avec un Score « red » selon le score de controverse de MSCI.

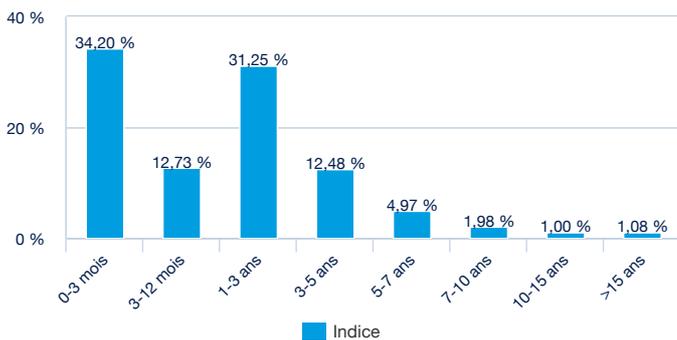
Caractéristiques (Source : Amundi)

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

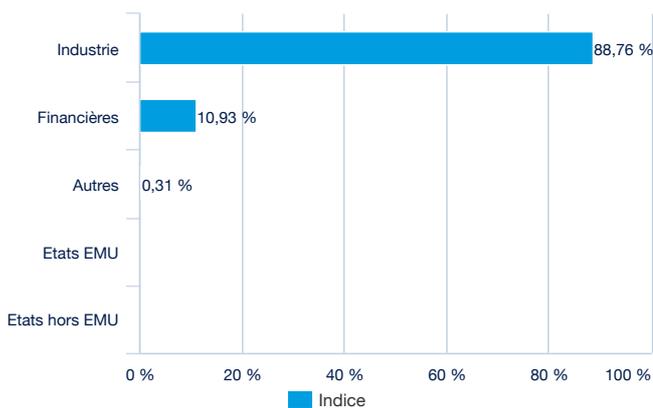
Nombre de valeurs : **1309**

Répartition de l'indice (Source : Amundi)

Par maturité (source : Amundi)



Par type d'émetteur (source : Amundi)



Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

| | % d'actifs (indice) |
|-----------------------|---------------------|
| DTV 5.875% 08/27 144A | 0,46% |
| CHTR 5.125% 01/27 | 0,40% |
| AAL 5.75% 04/29 144A | 0,39% |
| INTEL 6.5% 03/30 144A | 0,36% |
| UNIT 10.5% 02/28 144A | 0,35% |
| AAL 5.5% 04/26 144A | 0,34% |
| BCULC 4% 10/30 144A | 0,34% |
| CHTR 4.75% 03/30 144A | 0,33% |
| DVA 4.625% 06/30 144A | 0,32% |
| CHTR 4.25% 02/31 144A | 0,31% |
| Total | 3,61% |

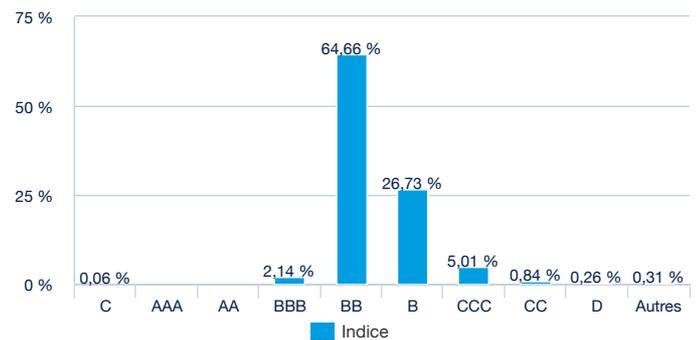
Indicateurs de l'indice (Source : Fund Admin)

| | Indice |
|-------------------------------|--------|
| Sensibilité ¹ | 3,56 |
| Taux de rendement | 6,93% |
| Notation Moyenne ² | B |

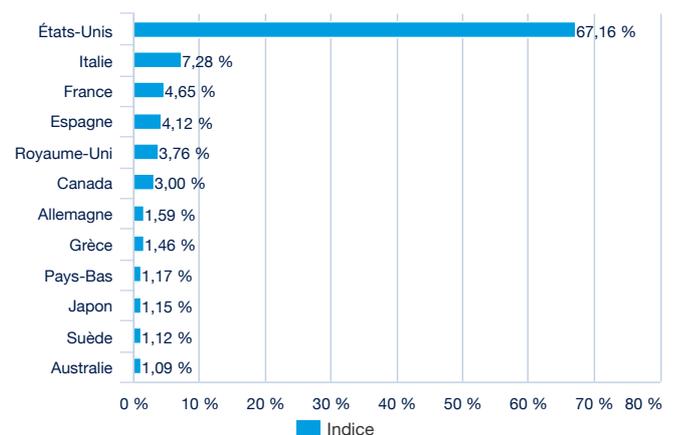
¹ La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence

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

Par notation (source : Amundi)



Par pays (source : Amundi)



OBLIGATAIRE ■

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 | DELOITTE S.A., LUXEMBOURG |
| Date de création de la classe | 16/01/2020 |
| Date de la première VL | 16/01/2020 |
| Devise de référence de la classe | USD |
| Classification AMF | Non applicable |
| Affectation des sommes distribuables | Capitalisation |
| Code ISIN | LU2099295466 |
| Minimum de souscription marché secondaire | 1 Part(s) |
| Périodicité de calcul de la VL | Quotidienne |
| Frais courants | 0,25% (prélevés) - 26/09/2022 |
| Durée minimum d'investissement recommandée | 3 ans |
| Clôture fiscale | Octobre |
| 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 |
|-----------------------|----------------------|--------|-------|------------------|----------------|-------------|--------------|
| London Stock Exchange | 9:00 - 17:30 | USD | GHYU | GHYU LN | GHYUUSIV | GHYU.L | GHYUUSIV |
| Borsa Italiana | 9:00 - 17:30 | EUR | GHYU | GHYE IM | GHYEEUIV | GHYE.MI | GHYEEUIV |
| Six Swiss Exchange | 9:00 - 17:30 | CHF | GHYU | GHYU SW | GHYUIV | GHYU.S | GHYUIV |

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

| | |
|-------------|----------------------|
| 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

Contact ETF Capital Market

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

OBLIGATAIRE ■

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 Global Corporate High Yield SRI Sustainable ».

Ni Barclays Bank PLC, Barclays Capital Inc., ou toute entité affiliée (collectivement « Barclays ») ni Bloomberg ne sont l'émetteur ou le producteur de LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF et ni Bloomberg ni Barclays n'ont de responsabilités, d'obligations ou de devoirs envers les investisseurs de LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF.

L'Indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable fait l'objet d'une licence d'utilisation par Amundi Asset Management en tant qu'émetteur de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable. La seule relation liant Bloomberg et Barclays à l'émetteur concernant l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable porte sur la licence de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable, qui est déterminé, composé et calculé par BISL, ou toute entité lui succédant, indépendamment de l'émetteur ou de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable ou des propriétaires de l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable.

En outre, Amundi, Gestionnaire d'actifs de LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF peut, en son nom, réaliser une ou plusieurs transactions avec Barclays sur ou concernant l'Indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable en relation avec LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF.

Les investisseurs acquièrent LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF de la part du Gestionnaire d'actifs Amundi, et les investisseurs n'acquièrent aucun intérêt dans Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable ; ils ne concluent par ailleurs absolument aucune relation d'affaires avec Bloomberg ou Barclays en effectuant un investissement dans LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF.

Les compartiments LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF 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 LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF 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 Global Corporate High Yield SRI Sustainable. Ni Bloomberg, ni Barclays ne s'est prononcé sur la légalité ou l'adéquation du compartiment LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF ou de toute tierce partie dans le cadre de la définition, de la constitution ou du calcul de l'Indice BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE. Ni Bloomberg, ni Barclays n'a d'obligation ou de responsabilité concernant l'administration, la commercialisation ou la négociation de parts du compartiment LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF.

Le contrat de licence liant Bloomberg et Barclays concerne uniquement ces derniers et aucunement les porteurs de parts du compartiment LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF, 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 LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF, 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 MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE 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 MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE 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 MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE OU TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. BLOOMBERG SE RÉSERVE LE DROIT DE MODIFIER SES MÉTHODES DE CALCUL OU DE PUBLICATION DE L'INDICE BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE 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 MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE. 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 MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT OU RELATIVE AU COMPARTIMENT LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF.

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.

OBLIGATAIRE ■

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 Global High Yield Sustainable Exposure 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 Global High Yield Sustainable Exposure 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 (DICI).

Le DICI 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.amundiETF.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 une 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.