

# Lyxor Global High Yield Sustainable Exposure UCITS ETF - Acc

REPORT  
MENSILE

31/03/2024

## Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : **21,13 ( USD )**  
 Data di valorizzazione : **28/03/2024**  
 Patrimonio in gestione : **54,93 ( milioni USD )**  
 Codice ISIN : **LU2099295466**  
 Tipo di replica : **Sintetico**  
 Benchmark :  
**100% BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE  
 HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE**  
 Prima data di NAV : **16/01/2020**  
 NAV alla data di istituzione : **20,00 ( USD )**

## Obiettivo di investimento

Il Lyxor Global High Yield Sustainable Exposure UCITS ETF è un etf conforme alla normativa UCITS che segue l'indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index.

Gli ETF di Amundi costituiscono efficaci veicoli d'investimento quotati in borsa che offrono un'esposizione trasparente, liquida e a basso costo all'indice di riferimento sottostante.

## Indicatore di rischio(Fonte : Fund Admin)



Rischio più basso

Rischio più alto

L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 3 anni. L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra incapacità di pagarvi quanto dovuto.

« I valori patrimoniali netti tecnici possono essere calcolati e pubblicati in ogni giorno solare (esclusi sabati e domeniche), che non sia un giorno lavorativo né un giorno di negoziazione. I suddetti valori patrimoniali netti tecnici sono meramente indicativi e non costituiranno la base per l'acquisto, la conversione, il rimborso e/o il trasferimento di azioni. »

## Performance (Fonte : Fund Admin) - I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri

### Performance del fondo \* (Fonte : Fund Admin)



### Indicatori di rischio (Fonte : Fund Admin)

	1 anno	3 anni	Data di lancio *
<b>Volatilità</b>	6,13%	7,48%	10,21%
<b>Volatilità dei benchmark</b>	6,12%	7,45%	10,19%
<b>Tracking Error ex-post</b>	0,01%	1,30%	1,10%
<b>Sharpe Ratio</b>	0,57	-0,49	-0,08

\* La volatilità è un indicatore statistico che misura l'ampiezza delle variazioni di un portafoglio rispetto alla sua media. Esempio: variazioni giornaliere di +/- 1,5% sui mercati corrispondono ad una volatilità annua del 25%. L'indicatore Tracking Error misura la differenza di rendimento tra il fondo e l'indice

### Performance\* (Fonte : Fund Admin)

	Da inizio anno	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni
A partire dal	29/12/2023	29/02/2024	29/12/2023	31/03/2023	31/03/2021	-	-
<b>Portafoglio</b>	0,23%	1,02%	0,23%	9,12%	-1,82%	-	-
<b>Benchmark</b>	0,35%	1,06%	0,35%	9,59%	-0,54%	-	-
<b>Scostamento</b>	-0,11%	-0,04%	-0,11%	-0,47%	-1,28%	-	-

### Performance annuale\* (Fonte : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
<b>Portafoglio</b>	12,37%	-13,58%	0,88%	-	-
<b>Benchmark</b>	12,86%	-13,21%	1,31%	-	-
<b>Scostamento</b>	-0,49%	-0,37%	-0,43%	-	-

\* Le performance sopra indicate si riferiscono a periodi completi di 12 mesi per ogni anno civile. **Le performance passate non sono assolutamente indicative dei risultati attuali e futuri e non garantiscono prossimi rendimenti.** I guadagni o le perdite eventuali non tengono conto delle spese, delle commissioni e delle imposte eventualmente sostenute dall'investitore al momento dell'emissione o del riscatto delle quote (es. tasse, spese di intermediazione o altre commissioni prelevate dall'intermediario finanziario...). Se le performance sono calcolate in una valuta diversa dall'euro, i guadagni o le perdite eventualmente generate possono essere influenzate dalle oscillazioni dei tassi di cambio (sia in rialzo che in ribasso). Lo scostamento corrisponde alla differenza di performance del portafoglio e dell'indice.

## Dati dell'indice (Fonte : Amundi)

## Descrizione

L'indice è rappresentativo della performance del mercato obbligazionario globale ad alto rendimento, con maturità di almeno 1 anno. L'indice include solamente emittenti con un rating MSCI ESG di BBB o migliore. L'indice valuta negativamente gli emittenti che operano in settori quali armi non convenzionali, e quelli che hanno un Punteggio Controversie MSCI ESG di "rosso".

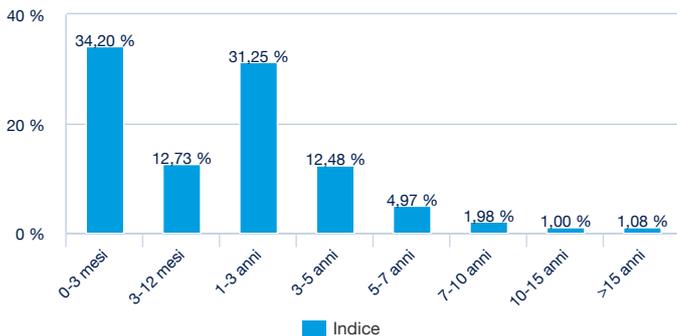
## Caratteristiche (Fonte : Amundi)

Classe di investimento : **Obbligazionario**  
Esposizione : **Internazionale**

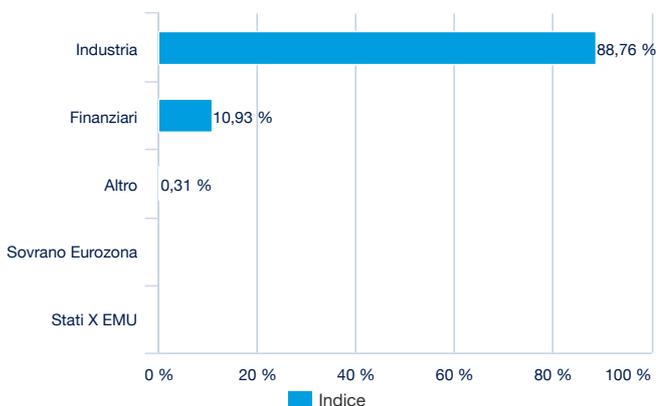
Numero di titoli : **1309**

## Ripartizione dell'indice (Fonte : Amundi)

## Per scadenza (Fonte : Amundi)



## Per tipo d'emittente (Fonte : Amundi)



## Primi dieci titoli dell'indice (Fonte : Amundi)

Titolo	% del peso sul Benchmark
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%
<b>Totale</b>	<b>3,61%</b>

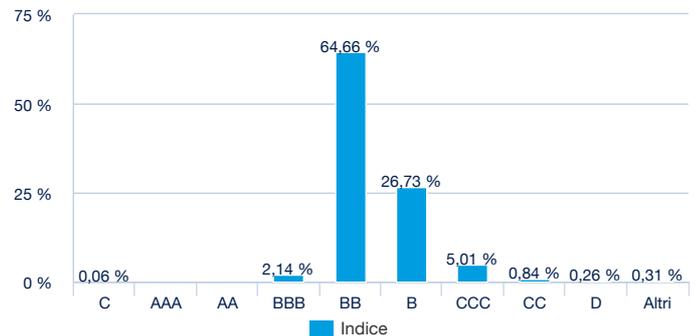
## Indicatori dell'indice (Fonte : Fund Admin)

Indicatore	Benchmark
Duration (in anni) <sup>1</sup>	3,56
Yield	6,93%
Notation Moyenne <sup>2</sup>	B

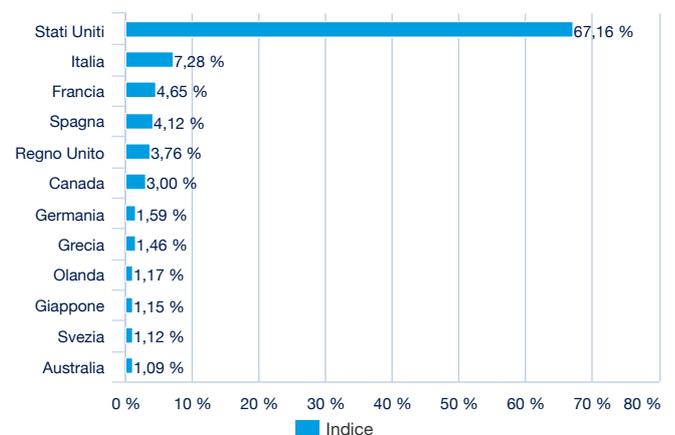
<sup>1</sup> La Modified Duration (in punti) rappresenta la variazione percentuale del prezzo a fronte di un'evoluzione dell'1% del tasso di riferimento.

<sup>2</sup> Basato sulle obbligazioni e sui CDS, eccetto qualunque altro derivato.

## Per rating (Fonte : Amundi)



## Per paese (Fonte : Amundi)



**Caratteristiche principali (Fonte : Amundi)**

Forma giuridica	OICVM di diritto lussemburghese
Normativa europea	OICVM
Società di gestione	Amundi Asset Management
Agente amministrativo	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Banca depositaria	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Revisore dei Conti	DELOITTE S.A., LUXEMBOURG
Data di lancio	16/01/2020
Prima data di NAV	16/01/2020
Valuta di riferimento della classe	USD
Classificazione	Non applicabile
Tipologia dei dividendi	Az. ad Accumulazione
Codice ISIN	LU2099295466
Minimo di sottoscrizione mercato secondario	1 Azione/quota
Frequenza di calcolo della quota	Giornaliera
Spese correnti	0,25% (prelevati) - 26/09/2022
Orizzonte d'investimento minimo consigliato	3 anni
Chiusura fiscale	Ottobre
Market Maker ufficiale	SOCIETE GENERALE / LANG & SCHWARZ

**Dati di negoziazione dell'ETF (Fonte : Amundi)**

Piazza	Orario	Valuta	Codice	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

**Contatti****Contatti commerciali ETF**

Francia & Lussemburgo	+33 (0)1 76 32 65 76
Germania & Austria	+49 (0) 800 111 1928
Italia	+39 02 0065 2965
Svizzera (Tedesco)	+41 44 588 99 36
Svizzera (Francese)	+41 22 316 01 51
UNITED KINGDOM (Retail)	+44 (0) 20 7 074 9598
UNITED KINGDOM (Instit)	+44 (0) 800 260 5644
Olanda	+31 20 794 04 79
Paesi nordici	+46 8 5348 2271
Hong Kong	+65 64 39 93 50
Spagna	+34 914 36 72 45

**Contatti Brokers ETF**

SG CIB	+33 (0)1 42 13 38 63
BNP Paribas	+44 (0) 207 595 1844

**Sede centrale**

**Amundi ETF**  
90 bd Pasteur  
CS 21564  
75 730 Paris Cedex 15 - France  
**Infoline** : +33 (0)1 76 32 47 74  
info@amundiETF.com

**Contatti ETF Capital Market**

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

**Dati Indici**

BLOOMBERG® è un marchio commerciale di Bloomberg Finance L.P. o delle relative consociate. BARCLAYS® è un marchio commerciale e di servizio di Barclays Bank Plc, (congiuntamente, insieme alle consociate, "Barclays"). MSCI® è un marchio commerciale e di servizio di MSCI, Inc. (congiuntamente, insieme alle consociate, compresa MSCI ESG Research LLC ("MSCI ESG"), "MSCI"). I summenzionati marchi sono utilizzati dietro licenza. Bloomberg Finance L.P. e le sue consociate, inclusa Bloomberg Index Services Limited "BISL") (collettivamente, "Bloomberg"), o i licenzianti di Bloomberg sono titolari di tutti i diritti di proprietà dell'indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable, la cui determinazione, composizione e calcolo sono di competenza di BISL, o di un eventuale avente causa di quest'ultimo, sulla base di ricerche ambientali, sociali e di governance fornite da MSCI ESG.

Bloomberg, Barclays ed MSCI non sono l'emittente né il produttore di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF e declinano ogni responsabilità, onere od obbligo nei confronti degli investitori di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF.

L'Indice è concesso in licenza d'uso da Amundi Asset Management, in veste di Emittente di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF. L'unico rapporto intercorrente tra Bloomberg, Barclays ed MSCI e l'Emittente in relazione all'Indice è la concessione in licenza dell'Indice, la cui determinazione, composizione e calcolo sono indipendenti dall'Emittente o da LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF o dai proprietari di BLOOMBERG BARCLAYS MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE.

Inoltre, l'emittente di BLOOMBERG BARCLAYS MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE può sottoscrivere operazioni per proprio conto con Barclays aventi ad oggetto o connesse all'indice in relazione ad LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF. Gli investitori acquistano partecipazioni in BLOOMBERG BARCLAYS MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE dall'emittente ma gli investitori non acquisiscono alcun titolo di proprietà sull'indice né entrano in alcun tipo di rapporto con Bloomberg, Barclays o MSCI contestualmente all'investimento in LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF. LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF non è sponsorizzato, approvato, venduto o promosso da Bloomberg, Barclays o MSCI. Bloomberg, Barclays ed MSCI non rilasciano alcuna dichiarazione o garanzia, esplicita o implicita, in merito all'opportunità di investire in LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF o all'opportunità in generale di investire o alla capacità dell'indice di replicare la corrispondente o relativa performance di mercato.

Bloomberg, Barclays ed MSCI non hanno trasmesso la legalità o l'idoneità di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF rispetto a qualsiasi soggetto o ente.

Bloomberg, Barclays ed MSCI non sono responsabili e non hanno partecipato alla determinazione delle tempistiche, dei prezzi o delle quantità di titoli di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF da emettere.

Bloomberg, Barclays ed MSCI non hanno alcun obbligo di prendere in considerazione le esigenze dell'Emittente o dei titolari di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF o di qualsiasi altra terza parte nella determinazione, composizione o calcolo dell'Indice Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable. Bloomberg, Barclays ed MSCI non hanno alcun obbligo o responsabilità in relazione all'amministrazione, alla commercializzazione o alla negoziazione di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF.

Il contratto di licenza in essere tra Bloomberg e Barclays e tra Bloomberg ed MSCI è esclusivamente a beneficio di Bloomberg e Barclays e di Bloomberg ed MSCI, rispettivamente, e non a beneficio dei proprietari di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF, degli investitori o di altre terze parti. Inoltre, il contratto di licenza in essere tra l'Emittente e Bloomberg è esclusivamente a beneficio dell'Emittente e di Bloomberg e non a beneficio dei proprietari di LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF, degli investitori o di altre terze parti.

BLOOMBERG, BARCLAYS ED MSCI DECLINANO OGNI RESPONSABILITÀ NEI CONFRONTI DELL'EMITTENTE, DEGLI INVESTITORI O DI EVENTUALI ALTRE TERZE PARTI IN MERITO ALLA PRECISIONE E/O COMPLETEZZA DELL'INDICE O DEI DATI IVI INCLUSI OPPURE PER INTERRUZIONI VERIFICATE NELLO STESSO. BLOOMBERG, BARCLAYS ED MSCI NON RILASCIANO ALCUNA GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN ORDINE AI RISULTATI CONSEGUIBILI DALL'EMITTENTE, DAGLI INVESTITORI O DA ALTRI SOGGETTI O ENTITÀ IN SEGUITO ALL'UTILIZZO DELL'INDICE O DI DATI IVI INCLUSI. BLOOMBERG, BARCLAYS ED MSCI DECLINANO OGNI RESPONSABILITÀ, ESPLICITA O IMPLICITA, ED ENTRAMBE NEGANO ESPRESSAMENTE TUTTE LE GARANZIE DI COMMERCIALIZZABILITÀ O IDONEITÀ PER UNO SCOPO O USO SPECIFICO IN RIFERIMENTO ALL'INDICE O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. BLOOMBERG SI RISERVA IL DIRITTO DI MODIFICARE I METODI DI CALCOLO O PUBBLICAZIONE, O DI CESSARE IL CALCOLO O LA PUBBLICAZIONE DELL'INDICE; NÉ BLOOMBERG, NÉ BARCLAYS, NÉ MSCI SONO RESPONSABILI DI EVENTUALI CALCOLI ERRATI O DI PUBBLICAZIONI ERRATE, TARDIVE O INTERROTTE IN RELAZIONE ALL'INDICE O A QUALSIASI DATO IVI CONTENUTO. NÉ BLOOMBERG, NÉ BARCLAYS, NÉ MSCI SARANNO RESPONSABILI DI EVENTUALI DANNI, INCLUSI, A TITOLO ESEMPLIFICATIVO, DANNI SPECIALI, INDIRETTI O CONSEGUENZIALI, NÉ DI EVENTUALI LUCRI CESSANTI, ANCHE SE CONSAPEVOLI DELL'EVENTUALITÀ CHE TALI DANNI SI SAREBBERO POTUTI VERIFICARE, DERIVANTI DALL'USO DELL'INDICE O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, O IN RELAZIONE AD LYXOR GLOBAL HIGH YIELD SUSTAINABLE EXPOSURE UCITS ETF.

Nessuna delle informazioni fornite da Bloomberg, Barclays ed MSCI e utilizzate nella presente pubblicazione può essere riprodotta in alcun modo senza la previa autorizzazione scritta di Bloomberg, Barclays Capital, la divisione investment banking di Barclays Bank PLC, e di MSCI. Barclays Bank PLC è iscritta al registro delle imprese in Inghilterra al numero 1026167, sede legale sita all'indirizzo 1 Churchill Place Londra E14 5HP

**Informazioni Legali / Disclaimer**

Il presente documento, predisposto da Société Générale, ha finalità di carattere meramente informativo. Le opinioni, i commenti e i giudizi ivi contenuti hanno solamente natura informativa. Nulla di quanto contenuto in questo documento deve intendersi come sollecitazione o offerta, consulenza in materia di investimenti, legale, fiscale o di altra natura o raccomandazione ad intraprendere qualsiasi investimento negli strumenti finanziari in oggetto. Il presente documento non è da considerarsi esaustivo e ha solo scopi informativi.

Amundi Asset Management (« Amundi AM ») non sono responsabili per eventuali danni, derivanti anche da imprecisioni e/o errori, che possano derivare all'investitore e/o a terzi dall'uso dei dati e delle informazioni contenuti nel presente documento. Le informazioni contenute nel presente documento possono provenire da fonti terze e, nonostante queste siano state utilizzate in quanto ritenute affidabili, Amundi Asset Management (« Amundi AM »), Amundi AM non assumono alcuna responsabilità sulla loro correttezza e completezza.

Il sottoscrittore non dovrà basare la propria decisione di investire nel prodotto sulle informazioni fornitigli nel presente documento bensì dovrà analizzare autonomamente i vantaggi ed i rischi del prodotto sotto gli aspetti legale, fiscale e contabile rivolgendosi, se lo riterrà opportuno, ai propri consulenti specializzati o ad altri professionisti competenti. Amundi AM potranno essere ritenute responsabili delle conseguenze finanziarie o di altra natura derivanti dall'investimento nei prodotti elencati.

La vendita del prodotto ad alcuni soggetti o in alcuni paesi potrebbe essere subordinata a restrizioni normative. Il valore dell'ETF può aumentare o diminuire nel corso del tempo. Si evidenzia che gli ETF rientrano nell'ambito delle disposizioni CONSOB inerenti allo short selling di volta in volta applicabili.

Il valore dell'ETF può aumentare o diminuire nel corso del tempo. Relativamente agli ETF che incorporano un effetto leva, il valore dell'ETF amplierà le oscillazioni al rialzo e/o al ribasso rispetto all'indice di riferimento, nel caso in cui questo non incorpori tale effetto leva. In ogni caso, si consideri che l'ETF potrebbe perdere in misura anche significativa il suo valore. Le commissioni indicate non considerano l'ammontare dell'imposta applicabile ai sensi del vigente regime fiscale e/o l'importo di eventuali commissioni, competenze o altri oneri a carico dell'investitore applicate dal proprio intermediario. L'applicazione del trattamento fiscale dipende dallo specifico status fiscale di ciascun investitore, nonché dalle leggi di volta in volta applicabili in materia. Si consideri, inoltre, che il trattamento fiscale potrà essere modificato in qualsiasi momento. Per ulteriori informazioni, si consiglia di chiedere assistenza al proprio consulente fiscale di fiducia.

I gestori degli indici di riferimento dei citati ETF non sponsorizzano, promuovono, distribuiscono o supportano gli ETF e non danno alcuna garanzia sul valore dell'indice e sui risultati derivanti dal suo uso e non sono responsabili di errori nell'indice.

**Prima dell'investimento negli ETF qui menzionati leggere attentamente il Prospetto Completo, il KIID ed il Documento di Quotazione** disponibili sul sito [www.amundi-etf.it](http://www.amundi-etf.it) e presso Amundi Asset Management, Via Cernaia, 8/10, 20121 Milano MI, Italia., ove sono illustrati in dettaglio i relativi meccanismi di funzionamento, i fattori di rischio e i costi.



Questo documento è rivolto ai soli investitori e distributori professionali, istituzionali o qualificati. Non è diretto al pubblico generico, clienti privati o investitori "retail" di qualsiasi giurisdizione e nemmeno ai residenti USA. Inoltre, ogni investitore dovrebbe essere, nell'Unione Europea, un investitore "professionale" così definito nella Direttiva 2004/39/CE del 21/04/2004 sugli strumenti finanziari (MIFID) o così indicato nelle regolamentazioni locali e, per quanto riguarda l'offerta in Svizzera, un "investitore qualificato" come previsto dalle Ordinanze Swiss Collective Investment Schemes del 23/06/2006 (CISA), Swiss Collective Investment Schemes del 22/11/2006 (CISO) e la circolare FINMA sulle offerte pubbliche interna alla legislazione sugli strumenti di investimento collettivo del 20/11/2008. In nessun caso questo documento può essere distribuito nell'Unione Europea a investitori "non professionali" come definiti dalla MIFID o da locali regolamentazioni, o in Svizzera agli investitori che non corrispondono alla definizione di "investitori qualificati" così definiti nella legislazione e regolamentazione in vigore.