AMUNDI ETF SHORT MSCI USA DAILY UCITS ETF

REPORT MENSILE

31/03/2024

Informazioni chiave (Fonte : Amundi)

Valore quota (NAV) : **5,06 (EUR)**
Data di valorizzazione : **28/03/2024**
Patrimonio in gestione : **36,51 (milioni EUR)**
Codice ISIN : **FR0010791194**
Tipo di replica : **Sintetico**
Benchmark : **MSCI USA Short Daily**

Obiettivo di investimento

L'obiettivo di AMUNDI ETF SHORT MSCI USA DAILY UCITS ETF è di replicare il più esattamente possibile, sia al rialzo che al ribasso, l'andamento dell'indice di strategia MSCI USA Short Daily, denominato in euro. Questo ETF consente di ottenere una correlazione inversa con l'andamento dell'indice MSCI USA. Pertanto, in caso di ribasso dell'indice, il valore patrimoniale netto di AMUNDI ETF SHORT MSCI USA DAILY UCITS ETF aumenterà e viceversa.

Indicatore di rischio *(Fonte : Fund Admin)*

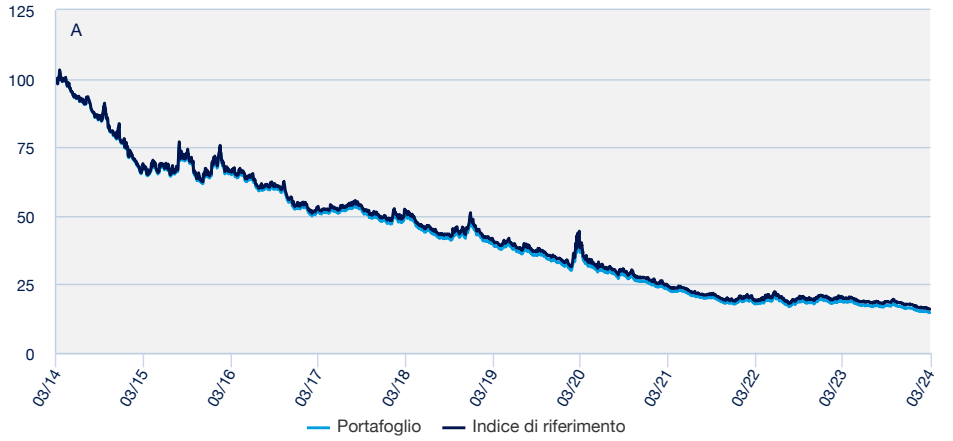
1	2	3	4	**5**	6	7

Rischio più basso — Rischio più alto

L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 5 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.

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

Performance del fondo * (Fonte : Fund Admin)



A : La valuta dell'indice è l'euro

Performance* (Fonte : Fund Admin)

A partire dal	Da inizio anno 29/12/2023	1 mese 29/02/2024	3 mesi 29/12/2023	1 anno 31/03/2023	3 anni 31/03/2021	5 anni 29/03/2019	Da inizio gestione 22/09/2009
Portafoglio	-10,41%	-2,88%	-10,41%	-20,65%	-36,58%	-62,94%	-92,95%
Benchmark	-10,14%	-2,81%	-10,14%	-19,58%	-34,65%	-61,13%	-92,11%
Scostamento	-0,27%	-0,08%	-0,27%	-1,07%	-1,93%	-1,82%	-0,84%

Performance annuale* (Fonte : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Portafoglio	-16,40%	8,61%	-30,01%	-22,38%	-28,43%	-5,30%	-9,15%	-16,47%	-16,07%	-24,48%
Benchmark	-15,27%	9,44%	-29,45%	-21,69%	-27,77%	-4,64%	-8,54%	-15,91%	-15,50%	-23,98%
Scostamento	-1,13%	-0,83%	-0,56%	-0,68%	-0,65%	-0,66%	-0,61%	-0,56%	-0,56%	-0,50%

** 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.*

Indicatori di rischio (Fonte : Fund Admin)

	1 anno	3 anni	Data di lancio *
Volatilità	10,83%	14,99%	16,95%
Volatilità dei benchmark	10,83%	14,99%	16,95%
Tracking Error ex-post	0,03%	0,04%	0,07%
Sharpe Ratio	-2,26	-1,01	-1,01

* 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

AMUNDI ETF SHORT MSCI USA DAILY UCITS ETF

REPORT MENSILE 31/03/2024

Dati dell'indice (Fonte : Amundi)

Descrizione

L'indice di strategia MSCI USA Short Daily offre un'esposizione giornaliera inversa, al rialzo e al ribasso, all'indice MSCI USA. Pertanto, se l'indice MSCI USA segna un rialzo, il NAV dell'ETF diminuisce e viceversa.

Caratteristiche (Fonte : Amundi)

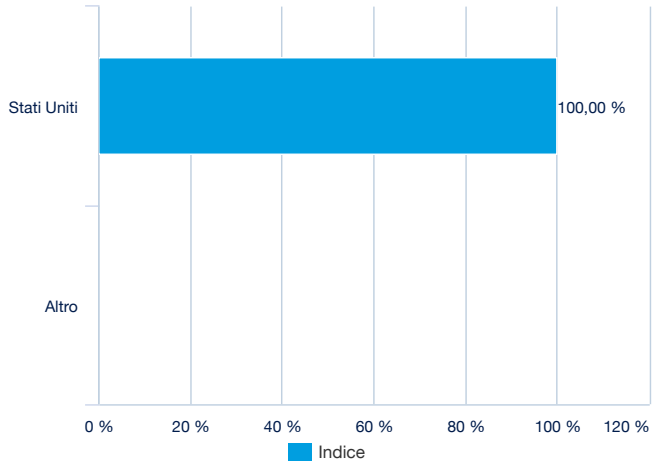
Classe di investimento : **Azionario**
Esposizione : **Nord America**
Valuta di riferimento dell'indice : **EUR**

Numero di titoli : **610**

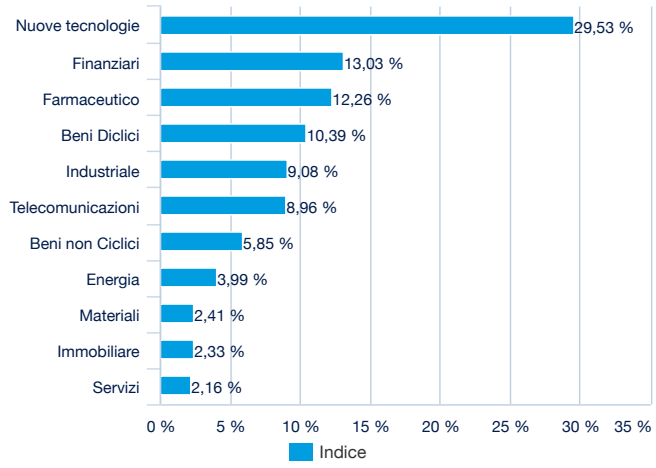
Primi dieci titoli dell'indice (Fonte : Amundi)

	% del peso sul Benchmark
MICROSOFT CORP	6,45%
APPLE INC	5,47%
NVIDIA CORP	4,85%
AMAZON.COM INC	3,64%
META PLATFORMS INC-CLASS A	2,34%
ALPHABET INC CL A	1,94%
ALPHABET INC CL C	1,70%
ELI LILLY & CO	1,36%
BROADCOM INC	1,28%
JPMORGAN CHASE & CO	1,26%
Totale	**30,29%**

Ripartizione geografica (Fonte : Amundi)



Ripartizione settoriale (Fonte : Amundi)



Dati di negoziazione dell'ETF (Fonte : Amundi)

Piazza	Orario	Valuta	Codice	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	C2U	C2U IM	INC2U	C2U.MI	INC2UINAV.PA
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	GC2U	GC2U GY	INC2U	GC2U.DE	INC2UINAV.PA
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	EUR	C2U	C2U FP	INC2U	C2U.PA	INC2UINAV.PA

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
Svizzeria (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 ETF Capital Market

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

Contatti Brokers ETF

BNP Paribas	+33 (0)1 40 14 60 01
Kepler Cheuvreux	+33 (0)1 53 65 35 25

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

Amundi ASSET MANAGEMENT | ETF

Amundi Asset Management, SAS (French : Société par Actions Simplifiée) con capitale di 1 143 615 555 €
Società di gestione del portafoglio approvata dell'AMF N° GP 04000036
Sede legale: 91-93, boulevard Pasteur – 75015 Parigi – Francia 437 574 452 RCS Parigi
Questo documento è esclusivamente destinato agli investitori « professionali »

Caratteristiche principali (Fonte : Amundi)

Forma giuridica	Fondo Comune di investimento Francese
Normativa europea	OICVM
Società di gestione	Amundi Asset Management
Agente amministrativo	CACEIS Fund Administration France
Banca depositaria	CACEIS Bank
Revisore dei Conti	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT
Data di lancio	22/09/2009
Prima data di NAV	22/09/2009
Valuta di riferimento della classe	EUR
Classificazione	Non applicabile
Tipologia dei dividendi	Accumulazione et/o Distribuzione
Codice ISIN	FR0010791194
Minimo di sottoscrizione mercato secondario	1 Azione/quota
Frequenza di calcolo della quota	Giornaliera
Spese correnti	0,35% (prelevati) - 30/12/2022
Orizzonte d'investimento minimo consigliato	5 anni
Chiusura fiscale	Dicembre
Market Maker ufficiale	BNP Paribas

Dati Indici

Tipologia di indice replicata : Azioni.
I Fondi non sono in nessuna modo sostenuti, approvati, commercializzati o promossi dalla società MSCI Inc. (“MSCI”), né da alcuna filiale di MSCI, né da alcun soggetto coinvolto nella determinazione degli indici MSCI.

Gli indici MSCI sono proprietà esclusiva di MSCI e i relativi marchi registrati di MSCI o delle sue filiali sono concessi in licenza, per determinate esigenze, a Amundi

MSCI, le filiali di MSCI e i soggetti implicati nella determinazione o nel calcolo degli indici MSCI non rilasciano alcuna dichiarazione e non emettono nessuna garanzia, espressa o implicita, nei confronti dei detentori di quote dei Fondi o più generalmente del pubblico, in merito all'opportunità della compravendita delle quote di fondi comuni di investimento in generale, o di quote dei Fondi in particolare, ovvero all’idoneità di qualsiasi indice MSCI di replicare esattamente la performance del mercato azionario globale.

Gli indici MSCI sono un marchio depositato della società MSCI per designare gli indici da essa calcolati e pubblicati. MSCI non garantisce né il valore degli indici in un dato momento, né i risultati o la performance dei prodotti indicizzati a tali indici.

Informazioni Legali / Disclaimer

Il fondo presenta un rischio di perdita in conto capitale non quantificabile. I rendimenti passati non sono indicativi né costituiscono una garanzia di risultati futuri. Per ulteriori informazioni sui rischi e prima di effettuare qualsiasi investimento, si prega di consultare il Documento contenente le informazioni chiave per gli investitori (KIID) e il prospetto informativo del fondo, disponibili in lingua francese su semplice richiesta o sul sito amundietf.fr Le informazioni contenute nel presente documento provengono da fonti ritenute attendibili. Amundi non può tuttavia garantirne l'esattezza e si riserva la possibilità di modificare in qualsiasi momento le analisi sopra riportate. Il presente documento non contrattuale non costituisce in alcun caso una raccomandazione, una sollecitazione di offerta o un'offerta di acquisto o di vendita relativa al fondo menzionato e non deve essere interpretato come tale. La politica di trasparenza e le informazioni relative alla composizione del patrimonio dei fondi sono disponibili su amundietf.com. Il valore patrimoniale netto indicativo viene pubblicato dalle borse valori. Generalmente le quote dei Fondi acquistate sul mercato secondario non possono essere rivendute direttamente al Fondo. Gli investitori devono comprare e vendere le quote su un mercato secondario con l'assistenza di un intermediario (ad esempio un broker) e possono quindi dover sopportare delle spese. È inoltre possibile che, al momento dell'acquisto delle quote, gli investitori paghino più del valore patrimoniale netto corrente e ricevano meno al momento della vendita. L'elenco completo dei broker e deglioperatori di borsa è disponibile su: amundietf.com Si applicano commissioni per l'intermediazionefinanziaria.

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.