# Amundi US Curve steepening 2-10Y- UCITS ETF Acc

FACTSHEET

Marketing-Anzeige

30/09/2024

ANLEIHEN

## Wesentliche Informationen (Quelle : Amundi)

Nettoinventarwert (NAV) : **96,48 ( USD )**
Datum des NAV : **30/09/2024**
Fondsvolumen : **823,10 ( Millionen USD )**
ISIN-Code : **LU2018762653**
Nachbildungsart : **Synthetischen**
Referenzindex :
**100% SOLACTIVE USD DAILY (X7) STEEPENER 2-10**
Datum der ersten NAV : **18/07/2019**
Erster NAV : **100,00 ( USD )**

## Anlageziel

Der Amundi US Curve Steepening 2-10 UCITS ETF - Acc ist ein OGAW-konformer börsengehandelter Fonds, dessen Ziel es ist, den Solactive USD Daily (x7) Steepener 2-10 Index abzubilden.

## Risiko-indikator *(Quelle: Fund Admin)*

1 **2** 3 4 5 6 7

Niedrigeres Risiko — Höheres Risiko

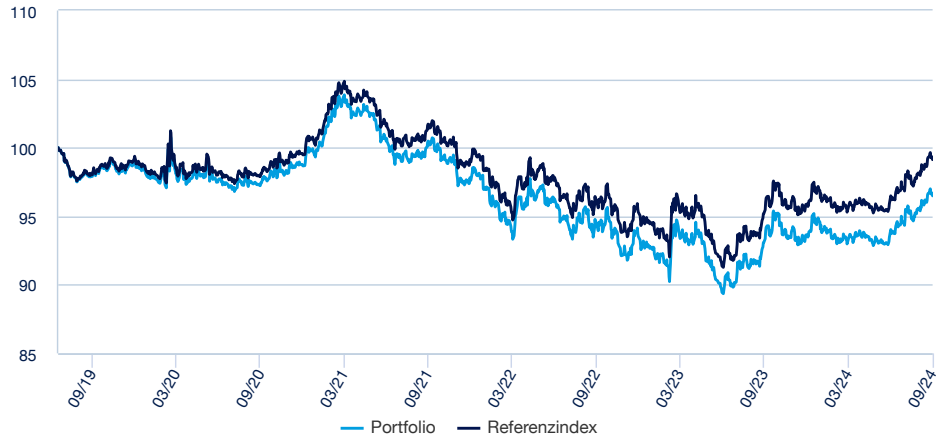
Der Risiko-Indikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt für 3 Jahre lang halten.
Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen.

**Potenzielle Anleger müssen die folgenden, im Prospekt des Fonds, der unter www.amundietf.de abrufbar ist, beschriebenen Risiken berücksichtigen.**
**KAPITALRISIKO :** ETF sind nachbildende Instrumente: Ihr Risikoprofil ähnelt dem einer direkten Anlage in dem zugrunde liegenden Index. Das Kapital der Anleger ist vollständig dem Risiko ausgesetzt und Anleger erhalten unter Umständen den ursprünglich investierten Betrag nicht zurück.
**REPLIKATIONSRISIKO :** Die Anlageziele des Fonds werden aufgrund unerwarteter Ereignisse an den zugrunde liegenden Märkten, die Indexberechnung und die effiziente Fondsnachbildung behindern, unter Umständen nicht erreicht.
**KONTRAHENTENRISIKO :** Die Anleger sind Risiken infolge der Verwendung eines OTC-Swap mit der MORGAN STANLEY BANK AG , SOCIETEGENERALE. ausgesetzt. Gemäß den OGAW-Richtlinien darf das mit der kontrahenten eingegangene Risiko 10% des Gesamtvermögens des Fonds nicht übersteigen.
**RISIKO IN VERBINDUNG MIT DEM BASISWERT :** Der zugrunde liegende Index eines Amundi-ETF kann komplex und volatil sein. Bei Anlagen in Rohstoffen wird der zugrunde liegende Index mit Bezug zu Rohstoff-Futures-Kontrakten berechnet, die den Anleger einem Liquiditätsrisiko in Verbindung mit den Kosten,wie zum Beispiel Fracht- und Transportkosten, aussetzen können. ETFs mit einem Engagement an Schwellenmärkten sind mit einem größeren Risiko möglicher Verluste verbunden als eine Anlage in Industrieländern, da sie vielfältigen und unvorhersehbaren Schwellenländerrisiken ausgesetzt sind.
**WÄHRUNGSRISIKO :** ETFs können einem Währungsrisiko unterliegen, wenn der ETF auf eine andere Währung als die Währung des nachgebildeten zugrunde liegenden Index lautet. Das bedeutet, dass die Wechselkursschwankungen die Renditen negativ oder positiv beeinflussen können.
**LIQUIDITÄTSRISIKO :** Die Liquidität wird durch zugelassene Market-Maker an der jeweiligen Börse, an der der ETF notiert ist, zur Verfügung gestellt. Die Liquidität an der jeweiligen Börse kann infolge einer Unterbrechung an dem Markt, der durch den von dem ETF nachgebildeten zugrunde liegenden Indexr epräsentiert wird, eines Ausfalls der Systeme einer der relevanten Börsen, der Market-Maker-Systeme oder einer unnormalen Handelssituation bzw. eines unnormalen Handelsereignisses beschränkt sein

*« Technische Nettoinventarwerte können für jeden Kalendertag (ausgenommen Samstage und Sonntage), der weder ein Geschäftstag noch ein Handelstag ist, berechnet und veröffentlicht werden. Diese Technische Nettoinventarwerte können für jeden Kalendertag sind lediglich Richtwerte und bilden nicht die Grundlage für den Kauf, den Umtausch, die Rücknahme und/oder die Übertragung von Anteilen."*

## Wertentwicklung (Quelle: Fondsadministrator) - *Die frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.*

### Wertentwicklung des Nettoinventarwertes (NAV) * von 18/07/2019 bis 30/09/2024 (Quelle : Fund Admin)




### Kumulierte Wertentwicklung* (Quelle: Fondsadministrator)

| | seit dem | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| seit dem | 29/12/2023 | 30/08/2024 | 28/06/2024 | 29/09/2023 | 30/09/2021 | 30/09/2019 | - |
| **Portfolio ohne Ausgabeaufschlag** | 3,06% | 0,94% | 3,23% | 3,65% | -3,95% | -1,44% | - |
| **Referenzindex** | 3,41% | 0,98% | 3,35% | 4,13% | -2,52% | 1,13% | - |
| **Abweichung** | -0,36% | -0,04% | -0,12% | -0,48% | -1,43% | -2,57% | - |

### Kalenderjahr Wertentwicklung* (Quelle: Fund Admin)

| | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 |
|---|---|---|---|---|---|
| **Portfolio ohne Ausgabeaufschlag** | 0,10% | -4,19% | -1,06% | -0,45% | - |
| **Referenzindex** | 0,57% | -3,69% | -0,52% | 0,10% | - |
| **Abweichung** | -0,48% | -0,50% | -0,54% | -0,55% | - |

### Risikoindikatoren (Quelle: Fund Admin) *

| | 1 Jahr | 3 Jahre |
|---|---|---|
| **Portfolio Volatilität** | 4,27% | 5,29% |
| **Referenzindex Volatilität** | 4,27% | 5,29% |
| **Tracking Error ex-post** | 0,01% | 0,01% |
| **Sharpe Ratio** | -0,40 | -0,96 |

* Die Volatilität ist ein statistischer Indikator, der die Schwankungen eines Vermögenswerts um seinen Mittelwert misst. Beispielsweise entspricht eine Marktschwankung von +/- 1,5% pro Tag einer Volatilität von 25% pro Jahr.
Der Tracking-Error stellt die annualisierte Volatilität der Performanceunterschiede zwischen dem ETF und der Benchmark dar.

** Quelle : Amundi.* ***Die Entwicklungen in der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf aktuelle und künftige Ergebnisse zu und sind keine Garantie für künftige Erträge****. Die eventuellen Gewinne oder Verluste berücksichtigen nicht die gegebenenfalls vom Anleger zu tragenden Kosten, Gebühren und Abgaben, die bei der Emission oder der Rücknahme von Anteilen anfallen (z.B.: Steuern, Vermittlungsgebühren oder sonstige vom Intermediär erhobene Gebühren). Wenn die Performances in einer anderen Währung als dem Euro berechnet werden, können die eventuell entstandenen Gewinne oder Verluste Wechselkursschwankungen unterliegen (d.h. sie können zu- oder abnehmen). Der Spread entspricht der Differenz zwischen der Performance des Portfolios und der des Index.*

## Das Investmentteam

## Index-Daten (Quelle: Amundi)

### Beschreibung

Der Index bildet die Anlageperformance einer systematischen Strategie ab, deren Rendite direkt mit Änderungen der US-Zinsstrukturkurve zusammenhängt. Der Index ist so konstruiert, dass bei einem Anstieg der Steigung der Kurve um 1 Basispunkt ein Anstieg des Index um ca. 7 Basispunkte erwartet wird, wenn auch Marktfaktoren zu Abweichungen führen können. Der Index besteht aus zwei Grundkomponenten: einer Long-Position in den 2-jährigen US-Treasury-Bond-Futures und einer Short-Position in den 10-jährigen US-Treasury-Ultra-Bond-Futures. Weitere Informationen zur Methodologie des Index finden Sie unter www.solactive.com.

### Informationen (Quelle : Amundi)

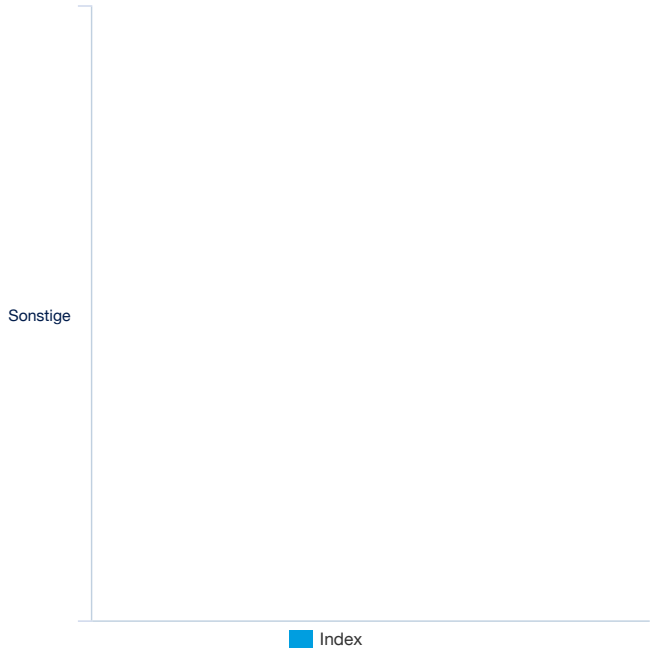
Anlageklasse : **Anleihen**
Klassifizierung : **USA**

Anzahl der Titel : **4**

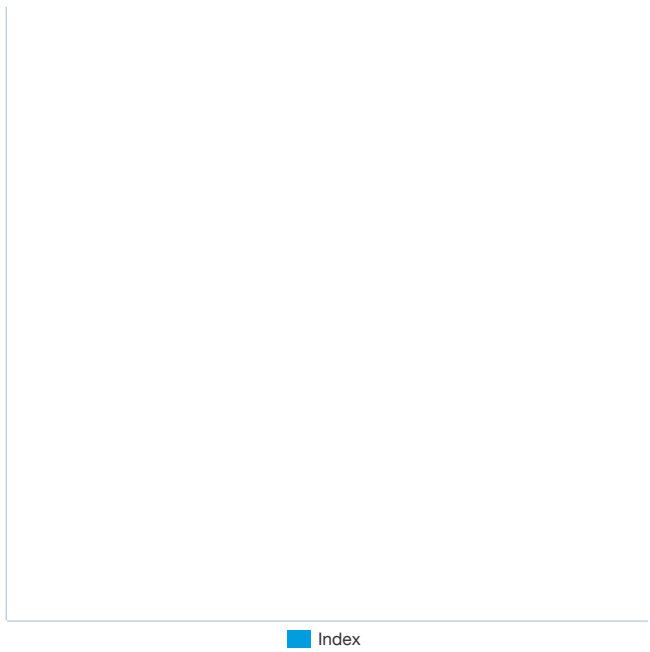
### Die größten Index-Positionen (Quelle : Amundi)

| | % vom Aktiva (Index) |
|---|---|
| **Summe** | **-** |

### Aufteilung nach Ländern (Quelle : Amundi)




### Aufteilung nach Sektoren (Quelle : Amundi)



## Handelsinformationen (Quelle : Amundi)

| Börsenplätze | Handelszeit | Währung | Mnemo | Ticker Bloomberg | INAV Bloomberg | RIC Reuters | INAV Reuters |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Nyse Euronext Paris | 9:00 - 17:30 | EUR | STPU | STPU FP | STPUEUIV | STPU.PA | STPUEUIV |
| London Stock Exchange | 9:00 - 17:30 | USD | STPU | STPU LN | STPUUSIV | STPU.L | STPUUSIV |
| Deutsche Börse | 9:00 - 17:30 | EUR | STPU | UCT2 GY | STPUEUIV | UCT2 DE | STPUEUIV |
| Borsa Italiana | 9:00 - 17:30 | EUR | STPU | STPU IM | STPUEUIV | STPU.MI | STPUEUIV |
| Berne Exchange | 9:00 - 17:30 | CHF | STPU | STPU BW | STPUIV | STPU.BN | STPUIV |

## Haupteigenschaften (Quelle: Amundi)

| | |
|---|---|
| Rechtsform | OGAW nach luxemburgischem Recht |
| OGAW konform | OGAW |
| Verwaltungsgesellschaft | Amundi Luxembourg SA |
| Administrator | SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG |
| Depotbank | SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG |
| Unabhängiger Wirtschaftsprüfer | PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG |
| Auflagedatum der Anlageklasse | 18/07/2019 |
| Referenzwährung der Anteilsklasse | USD |
| Klassifizierung | Nicht anwendbar |
| Ertragsverwendung | Thesaurierend |
| ISIN-Code | LU2018762653 |
| Mindestanlage am Sekundärmarkt | 1 Anteil(e) |
| Häufigkeit der Berechnung des Nettoinventarwerts | Täglich |
| Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten | 0,30% |
| Ausgabeaufschlag (maximal) | 5,00% |
| Rücknahmeabschlag (maximal) | 5,00% |
| Fiskaljahresende | September |

## Index-Anbieter

Solactive AG sponsert, fördert, verkauft oder unterstützt in keiner anderen Weise die finanziellen instrument und Solactive AG gibt keine explizite oder implizite Garantie oder Darstellung der Ergebnisse, die sich aus der Verwendung des Index und/oder des Index ergeben Marke, der Indexwert zu einem bestimmten Zeitpunkt oder in anderer Hinsicht. Der Index ist berechnet und veröffentlicht von der Solactive AG, die alles daran setzt, dass die Berechnung des Index ist korrekt. Unabhängig von ihrer Verpflichtung gegenüber dem Emittenten, Solactive AG gegenüber Dritten, einschließlich Investoren und/oder Finanzunternehmen, nicht verpflichtet ist Intermediäre des Finanzinstruments, um auf mögliche Fehler im Index hinzuweisen. Die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG und Lizenzierung des Index und Index Die Marke zur Verwendung im Zusammenhang mit dem Finanzinstrument stellt keine Empfehlung der Solactive Ag für eine Kapitalanlage oder in irgendeiner Weise Gewährleistung oder Stellungnahme der Solactive AG hinsichtlich einer Investition in diese finanzielle Instrument.

## Wichtige Hinweise

Eine Anlage im Fonds ist mit einem nicht absehbaren Kapitalverlustrisiko verbunden. Die Entwicklungen in der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf künftige Ergebnisse zu und sind keine Garantie für künftige Erträge. Weitere Angaben zu den Risiken und vor einer Anlageentscheidung erhalten Sie in den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) und im Verkaufsprospekt dieses Fonds, die auf Anfrage oder auf der Website amundietf.fr in französischer Sprache erhältlich sind. Die in diesem Dokument enthaltenen Angaben stammen aus als zuverlässig geltenden Quellen. Dennoch kann Amundi keine Gewähr für deren Richtigkeit übernehmen und behält sich das Recht vor, jederzeit Änderungen an den vorstehenden Analysen vornehmen zu können. Dieses Dokument ist kein Vertrag und stellt keinesfalls eine Empfehlung, ein Angebotsgesuch oder ein Angebot zum Kauf oder Verkauf im Zusammenhang mit dem genannten Fonds dar und darf keinesfalls so ausgelegt werden. Die Transparenzpolitik und Informationen über die Zusammensetzung der Fondsvermögen stehen auf amundietf.com zur Verfügung. Der indikative Nettoinventarwert wird von den Börsen veröffentlicht. Anteile der Fonds, die auf dem Sekundärmarkt gekauft werden, können in der Regel nicht direkt an den Fonds zurückverkauft werden. Anleger müssen Anteile mit der Unterstützung durch Intermediäre (beispielsweise eines Maklers) auf einem Sekundärmarkt kaufen und verkaufen, wodurch Gebühren fällig werden können. Zudem besteht die Möglichkeit, dass Anleger mehr zahlen als den aktuellen Nettoinventarwert, wenn Sie Anteile kaufen, und beim Verkauf weniger als den aktuellen Nettoinventarwert erhalten. Amundi Suisse SA ist als Vertriebsträger von kollektiven Kapitalanlagen bewilligt. Amundi Suisse SA vertreibt in der Schweiz und aus der Schweiz kollektive Kapitalanlagen, die von Amundi und/oder Amundi Luxembourg SA verwaltet werden. Zu diesem Zweck informiert Amundi Suisse SA hiermit die Anleger , dass sie von Amundi und/oder Amundi Luxembourg SA Kommissionen nach Art. 34 Abs. 2bis der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (Kollektivanlagenverordnung, KKV) erhält. Die Kommission kann einen Teil der Verwaltungsgebühr, bezeichnet im Verkaufsprospekt, darstellen. Zusätzliche Informationen im Hinblick auf die Existenz, die Natur und die Berechnungsmethode der Kommissionen können von Amundi Suisse SA im Rahmen der Vertriebstätigkeit in der Schweiz oder aus der Schweiz auf schriftliche Anfrage erhalten werden bei Amundi Suisse SA 6-8 rue de Candolle 1205 Genève Suisse. Für jeden der Fonds gibt es einen von der französischen Finanzmarktaufsicht (AMF) genehmigten Verkaufsprospekt und wesentliche Anlegerinformationen, die vor einer Zeichnung bereitgestellt werden müssen. Die Vertriebsunterlagen jedes Fonds (Verkaufsprospekt und wesentliche Anlegerinformationen, Verwaltungsreglement, Finanzberichte und andere regelmäßig erscheinende Dokumente) sind auf Wunsch bei Amundi oder über die Website amundietf.com erhältlich. Die Vertriebsunterlagen der für die öffentliche Vermarktung in Deutschland zugelassenen Fonds sind kostenlos und in Papierform erhältlich bei Marcard, Stein & Co. AG, Ballindamm 36, 20095 Hamburg, Deutschland. Eine vollständige Liste der Broker und Market Maker finden Sie auf: amundietf.com Gebühren für Finanzintermediäre könnenanfallen. Der Vertrieb dieses Fonds in der Schweiz erfolgt ausschliesslich an qualifizierte Anleger im Sinne des schweizerischen Gesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) und dessen Durchführungsverordnung. Der Fonds ist von der FINMA nicht für den Vertrieb an nicht qualifizierte Anleger zugelassen. Die wesentlichen Informationen für den Anleger (KIID), der Verkaufsprospekt, die Satzung sowie die Jahres- und/oder Halbjahresberichte des Fonds sind kostenlos beim Vertreter in der Schweiz (CACEIS (Switzerland) SA, route de Signy 35, 1260 Nyon) erhältlich. Im Rahmen des Vertriebs in der Schweiz gilt der Sitz des Vertreters als Erfüllungsort und Gerichtsstand. Zahlstelle des Fonds in der Schweiz ist CREDIT AGRICOLE (SUISSE) SA, quai Général-Guisan 4, 1204 Genf.