

AMUNDI INDEX EURO CORP BBB 1-5 - IE

FACTSHEET

Marketing-
Anzeige

28/02/2022

ANLEIHEN ■

Wesentliche Informationen (Quelle : Amundi)

Nettoinventarwert (NAV) : (C) 1.029,81 (EUR)
(D) 987,93 (EUR)
Datum des NAV : 28/02/2022
Fondsvolumen : 572,17 (Millionen EUR)
ISIN-Code : LU1525412018
Bloomberg-Code : AMECIEC LX
Referenzindex :
100% BLOOMBERG EURO CORPORATE BBB 1-5 YEAR

Anlageziel (Quelle : Amundi)

Der AMUNDI INDEX BARCLAYS EURO CORP BBB 1-5 ist darauf ausgelegt, die (positive wie negative) Entwicklung des auf den Euro lautenden Barclays Euro Corporate BBB 1-5 Year Index auf Basis der Gesamtrendite (d. h. auf Basis reinvestierter Dividenden) so genau wie möglich nachzubilden. Dieser Teilfonds bietet eine Anlagen in auf Euro lautenden Unternehmensanleihen mit einer Laufzeit von 1 bis 5 Jahren und einem Rating von BBB.

Risiko- und Renditeprofil (SRRI) (Quelle: Fund Admin)



■ Niedrige Risiken, potenziell niedrigere Erträge

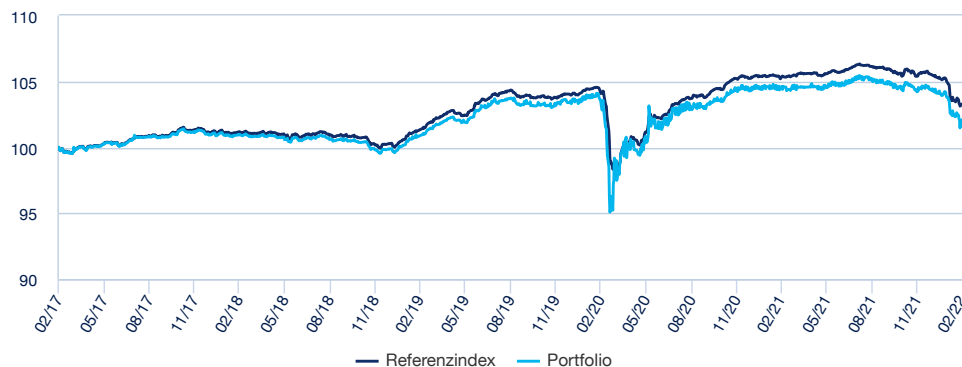
■ Hohe Risiken, potenziell höhere Erträge

Das SRRI entspricht dem in den wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) angeführten Risiko- und Renditeprofil. Die niedrigste Kategorie kann nicht mit einer „risikofreien Anlage“ gleichgesetzt werden. Sie ist nicht garantiert und kann sich im Laufe der Zeit verändern.

« 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 28/02/2017 bis 28/02/2022 (Quelle : Fund Admin)



Kumulierte Wertentwicklung* (Quelle: Fondsadministrator)

	seit dem	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	seit dem
	31/12/2021	31/01/2022	30/11/2021	26/02/2021	28/02/2019	28/02/2017	06/12/2016
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	-2,11%	-1,62%	-2,20%	-2,26%	1,19%	2,09%	2,98%
Referenzindex	-2,07%	-1,46%	-2,00%	-1,82%	1,93%	3,28%	4,46%
Abweichung	-0,03%	-0,17%	-0,20%	-0,44%	-0,74%	-1,20%	-1,48%

Kalenderjahr Wertentwicklung* (Quelle: Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	-0,07%	1,02%	3,45%	-1,06%	1,42%
Referenzindex	0,15%	1,30%	3,70%	-0,83%	1,65%
Abweichung	-0,22%	-0,28%	-0,24%	-0,23%	-0,23%

* 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.

Risikoindikatoren (Quelle : Amundi)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Portfolio Volatilität	1,83%	4,05%	3,18%
Referenzindex Volatilität	1,61%	2,67%	2,14%
Tracking Error ex-post	1,01%	2,54%	1,96%
Sharpe Ratio	-1,03	0,20	0,25
Information Ratio	-0,43	-0,09	-0,12

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.
sharp_ratio_indicator

Indikatoren (Quelle : Amundi)

	Portfolio
Modifizierte Duration ¹	2,79
Durchschnittliches Rating ²	BBB
Renditen	1,07%

¹ Die modifizierte Duration (in Punkten) zeigt die prozentuale Änderung des Preises bei einer Veränderung des Referenzzinssatzes um 1%.

² Basierend auf Anleihen und CDS, jedoch ohne sonstige Derivate

Anzahl der Titel : 941

ANLEIHEN ■



Stéphanie Pless

Head of Inflation



Fadil Hannane

Lead Portfolio Manager

Kommentar des Managements

Die hohe Teuerungsrate und die russische Invasion in der Ukraine bescherten den Märkten im Februar eine hohe Volatilität. Im Anschluss an die Erklärungen der Währungshüter angesichts der hohen Inflation stieg das Angstbarometer VIX in der ersten Februarhälfte um +29 %. Die Präsidentin der EZB Christine Lagarde räumte auf der letzten Sitzung ein, dass sich „die Situation geändert hat“. Im Dezember und Januar gab es einen überraschend kräftigen Preisschub, sodass die EZB-Chefin erklärte, im EZB-Rat herrsche „einhellige Besorgnis“ über die Inflationsdaten. Der US-Verbraucherpreisindex (CPI) kletterte auf 7,5 % statt wie erwartet auf 7,3 %. Damit bestätigte sich die Inflationsbeschleunigung, die nach einer kräftigeren Straffung der Zinszüge seitens der US-Notenbank ruft. Die Rendite zehnjähriger US-Treasuries legte daraufhin unmittelbar auf über 2 % und damit den höchsten Stand seit August 2019 zu. Die Rendite zehnjähriger deutscher Bundesanleihen rückte dagegen um 7 Bp. auf 0,28 % vor. Die russische Invasion in der Ukraine am 24. Februar 2022 verstärkte die ohnehin vorhandenen Ängste an den Märkten zusätzlich, sodass der VIX 33 % nach oben sprang. Er beendete den Monat 22,43 % höher bei 30 %.

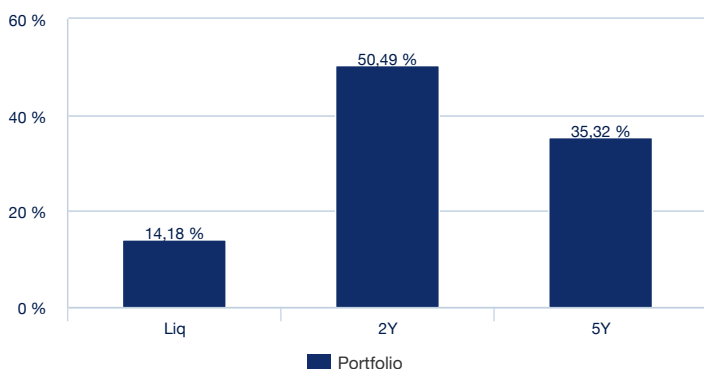
In diesem Umfeld weiteten sich die Spreads von auf Euro lautenden Investment-Grade-Anleihen um 33 Bp. auf 148 Bp. Das Fondsergebnis wurde durch die Spreadweitung und durch den Anstieg der Staatsrenditen geschmälert (die Rendite fünfjähriger Bundesanleihen verbesserte sich um 29 Bp. auf -0,19 % und die Bundrendite um 9 Bp. auf 0,10 %). Der Markt beendete den Monat -2,69 % tiefer (relative Performance von -1,87 % im Vergleich zu Schatzanweisungen mit gleicher Duration).

Wenig überraschend gaben Anleihen mit hohem Beta nach. Die Verluste waren allerdings nicht so stark wie bei Aktien (EuroStoxx -5,92 %), AT1-Bankpapieren, hybriden Unternehmensanleihen und High-Yield-Anleihen, die -3,62 %, -3,68 % bzw. -3,11 % verbuchten. Auf Sektorebene verzeichneten die vom aktuellen Umfeld am stärksten betroffenen und beeinträchtigten Sektoren Energie und Versorger eine relative Performance von -2,55 % bzw. -2,13 % gegenüber Schatzanweisungen mit gleicher Duration.

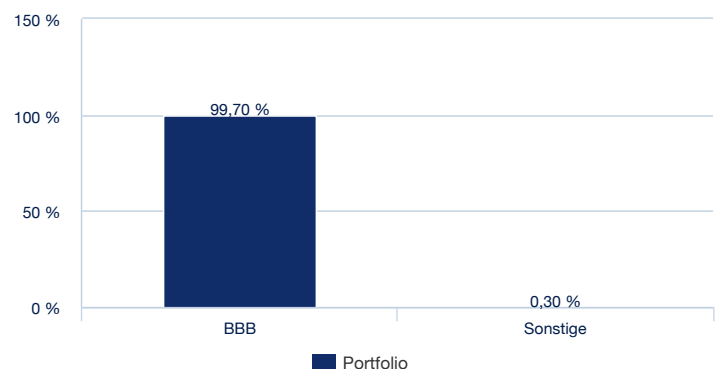
Dieses Portfolio wird indexorientiert verwaltet, wobei der Barclays Euro Corporate BBB 1-5 Year als Referenzindex dient. Wir verringerten die relative Sensitivität des Portfolios im Vergleich zum Referenzindex so weit wie möglich und legten in einer begrenzten Anzahl von Titeln an, um das Risiko minimal zu halten.

Aufteilung (Quelle : Amundi)

Nach Laufzeit (Quelle : Amundi)

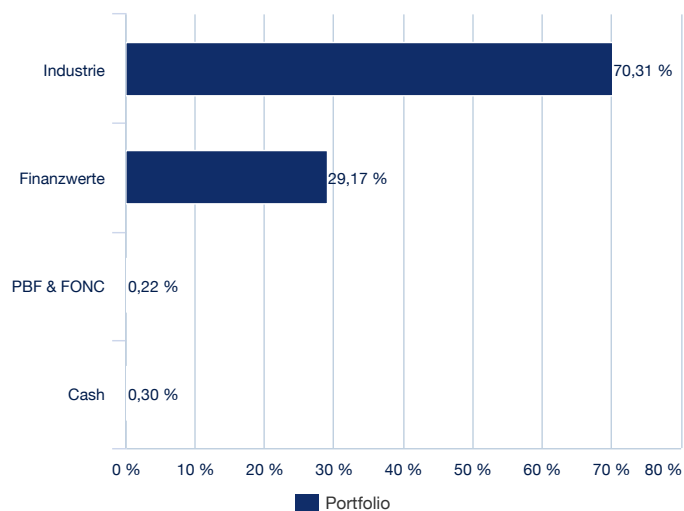


Nach Rating (Quelle : Amundi)

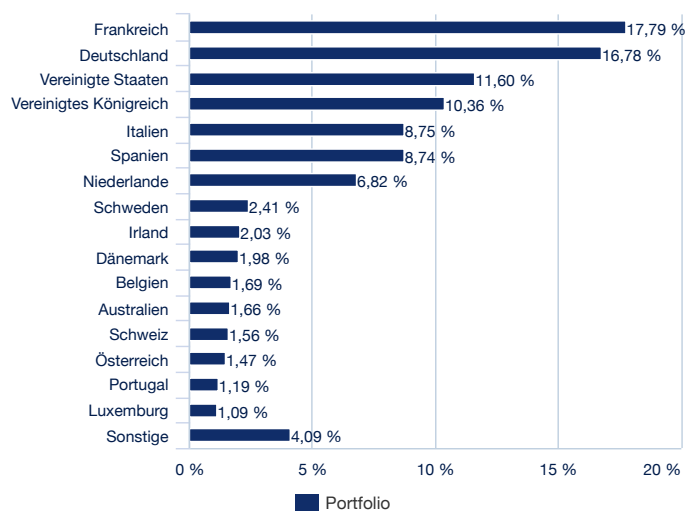


ANLEIHEN ■

Nach Emittent (Quelle : Amundi)



Nach Ländern (Quelle : Amundi)



ANLEIHEN ■

Hauptmerkmale (Quelle: Amundi)

Rechtsform	OGAW
Anwendbares Recht	nach luxemburgischem Recht
Verwaltungsgesellschaft	Amundi Luxembourg SA
Depotbank	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Auflagedatum der Anlageklasse	29/11/2016
Referenzwährung der Anteilsklasse	EUR
Klassifizierung	Nicht anwendbar
Ertragsverwendung	(C) Thesaurierend (D) Ausschüttend
ISIN-Code	(C) LU1525412018 (D) LU1525412109
Bloomberg-Code	AMECIEC LX
Mindestanlagebetrag bei Erst-/Folgezeichnung	500000 Equivalent in EUR aus USD / 1 Tausendstel-Anteil(e)/Aktie(n)
Häufigkeit der Berechnung des Nettoinventarwerts	Täglich
Uhrzeit für den Handelsschluss	Anträge pro Tag T vor 14:00
Ausgabeaufschlag (maximal)	2,50%
Verwaltungskosten	0,10% Inkl. Steuern
Erfolgsabhängige Gebühr	Nein
Performancevergütung (% pro Jahr)	-
Rücknahmeabschlag (maximal)	0,00%
Laufende Kosten	0,20% (erhoben) - 30/09/2021
Empfohlene Mindestanlagedauer	4 Jahre
Übersicht zur Entwicklung des Referenzindex	29/11/2016: 100.00% BLOOMBERG EURO CORPORATE BBB 1-5 YEAR
OGAW konform	OGAW
Zu aktueller/unbekanntem kurs	Zu unbekanntem kurs
Wertstellungstag Kauf	T+2
Wertstellungstag Subskription	T+2
Besonderheit	Nein
Externes Fondsmanagement	Amundi Asset Management

Wichtige Hinweise

Dieses Dokument dient nur zu Informationszwecken und stellt keinesfalls eine Anlageberatung, Finanzanalyse oder eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Anteilen oder Aktien der in diesem Dokument präsentierten FCP, FCPE, SICAV, SICAV-Teilfonds oder SPPICAV („die OGA“) dar und darf keinesfalls so ausgelegt werden. Dieses Dokument stellt nicht die Grundlage eines Vertrages oder einer Verpflichtung gleich welcher Art dar. Alle in diesem Dokument enthaltenen Angaben können ohne vorherige Ankündigung geändert werden. Der aktuelle Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“), die Satzung, der Jahres- und der Halbjahresbericht sind kostenlos und in gedruckter Form bei der Zahl- und Informationsstelle (Marcard, Stein & Co AG, Ballindamm 36, D-20095 Hamburg, Deutschland) erhältlich und auf unserer Website www.amundi.com verfügbar. Die Verwaltungsgesellschaft übernimmt keinerlei Haftung, weder direkt noch indirekt, die sich durch die Nutzung sämtlicher in diesem Dokument enthaltenen Angaben ergeben könnte. Die Verwaltungsgesellschaft haftet keinesfalls für Entscheidungen, die auf Grundlage dieser Angaben getroffen werden. Die Angaben in diesem Dokument werden Ihnen auf vertraulicher Basis mitgeteilt und dürfen ohne vorherige schriftliche Zustimmung der Verwaltungsgesellschaft von keinem Dritten und in keinem Land, in dem diese Veröffentlichung oder Nutzung geltenden Rechtsvorschriften zuwiderläuft, oder demzufolge die Verwaltungsgesellschaft oder ihre Fonds verpflichtet wären, sich im besagten Land bei Aufsichtsbehörden registrieren zu lassen, weder kopiert noch vervielfältigt noch geändert noch übersetzt noch veröffentlicht werden. Nicht alle OGA sind unbedingt im jeweiligen Rechtsgebiet sämtlicher Anleger eingetragen. Anlagen beinhalten Risiken: Die Wertentwicklungen in der Vergangenheit der in diesem Dokument präsentierten OGA sowie die auf Basis dieser Wertentwicklungen durchgeführten Simulationen sind kein verlässlicher Indikator für zukünftige Wertentwicklungen. Sie lassen keine Rückschlüsse auf den künftigen Wertverlauf zu. Der Wert der Anteile oder Aktien der OGA unterliegt den Preisschwankungen auf dem Markt. Daher können die getätigten Anlagen sowohl steigen als auch fallen. Somit können Zeichner der OGA ihr anfänglich investiertes Kapital ganz oder teilweise verlieren. An den OGA interessierte Personen müssen vor jeder Zeichnung sicherstellen, dass die Zeichnung mit den auf sie zutreffenden Gesetzen vereinbar ist, sich der steuerlichen Folgen einer solchen Anlage vergewissern und die geltenden gesetzlich vorgeschriebenen Dokumente jedes OGA zur Kenntnis nehmen. Die Daten dieses Dokuments stammen von der Verwaltungsgesellschaft (sofern nicht anders angegeben). Der Stand der Daten dieses Dokuments entspricht dem am Beginn des Abschnitts MONATLICHE VERWALTUNGSÜBERSICHT“ angegebenen Datum (sofern nicht anders angegeben).

Dieses Dokument ist ausschließlich für institutionelle, professionelle, qualifizierte oder erfahrene Anleger und Vertriebsstellen bestimmt. Es darf nicht an die breite Öffentlichkeit, Privatkunden oder Einzelanleger in irgendeinem Land und nicht an „US-Personen“ ausgegeben werden. Darüber hinaus sollte ein solcher Anleger in der Europäischen Union ein „professioneller“ Anleger im Sinne der Richtlinie 2004/39/EG vom 21. April 2004 über Märkte für Finanzinstrumente („MIFID“) bzw. im Sinne der jeweiligen lokalen Vorschriften und, im Hinblick auf das Angebot in der Schweiz, ein „qualifizierter Anleger“ im Sinne der Bestimmungen des schweizerischen Gesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG), der schweizerischen Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen vom 22. November 2006 (KKV) und des Rundschreibens 08/8 der FINMA im Sinne der Gesetzgebung über die kollektiven Kapitalanlagen vom 20. November 2008 sein. Das Dokument darf in der Europäischen Union unter keinen Umständen an nicht „professionelle“ Anleger im Sinne der MIFID oder der jeweiligen lokalen Vorschriften oder in der Schweiz an Anleger, auf welche die in den geltenden Gesetzen und Vorschriften enthaltene Definition von „qualifizierten Anlegern“ nicht zutrifft, ausgegeben werden.