AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA - UCITS ETF DR - EUR

MONATLICHES FACTSHEET

31/01/2020

WERBUNG

Wesentliche Informationen (Quelle : Amundi)

Nettoinventarwert (NAV) : **443,83 (EUR)**
Datum des NAV : **31/01/2020**
ISIN-Code : **LU1602145119**
WKN : **A2DR4K**
Fondsvolumen : **327,86 (Millionen EUR)**
Referenzwährung des Teilfonds : **EUR**
Referenzwährung der Anteilsklasse : **EUR**
Referenzindex :
100.0% SCIENTIFIC BETA DEVELOPED MULTI-BETA MULTI-STRATEGY ERC FOUR FACTOR

Anlageziel

Ziel ist es, die Wertentwicklung des Strategieindex Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy ERC (der „Strategieindex“) so genau wie möglich nachzubilden, gleich ob diese positiv oder negativ ist. Die Performanceabweichung zwischen dem Teilfonds und seinem Referenzindex soll nicht mehr als 1% betragen.

Risiko- und Renditeprofil (SRRI)

1	2	3	4	**5**	6	7

Niedrige Risiken, potenziell niedrigere Erträge

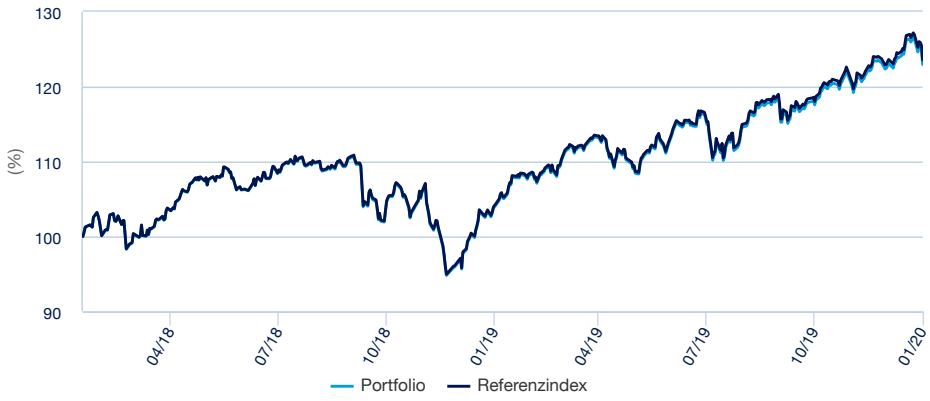
Hohe Risiken, potenziell höhere Erträge

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

Performanceentwicklung (Basis: 100) * von 14/02/2018 bis 31/01/2020



Kumulierte Wertentwicklung*

	seit dem	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	seit dem
seit dem	31/12/2019	31/12/2019	31/10/2019	31/01/2019	-	-	14/02/2018
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	0,44%	0,44%	4,59%	18,27%	-	-	22,96%
Referenzindex	0,50%	0,50%	4,70%	18,64%	-	-	23,57%
Abweichung	-0,06%	-0,06%	-0,11%	-0,37%	-	-	-0,61%

Wertentwicklung des Fonds *

	2016	2017	2018	2019	2020
Per	-	-	-	-	31/01/2020
seit dem	-	-	-	-	31/01/2019
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	-	-	-	-	18,27%
Referenzindex	-	-	-	-	18,64%
Abweichung	-	-	-	-	-0,37%

Hauptmerkmale

Fondsstruktur : **OGAW**
Anwendbares Recht :
nach luxemburgischem Recht
Gründungsdatum des Teilfonds : **29/06/2016**
Auflagedatum der Anlageklasse : **20/04/2017**
Ertragsverwendung : **Thesaurierend**
Ausgabeaufschlag (laufend) : **-**
Ausgabeaufschlag : **0,00% (im Börsenhandel)**
Verwaltungsvergütung p.a. : **0,28%**
Laufende Kosten : **0,40% (erhoben 30/09/2019)**
Empfohlene Mindestanlagedauer : **5 Jahre**
Erfolgsabhängige Gebühr : **Nein**
Performancevergütung (% pro Jahr) : **-**

Risikoindikatoren (Quelle : Amundi)

	1 Jahr	3 Jahre	seit Auflegung
Portfolio Volatilität	8,86%	-	11,78%
Referenzindex Volatilität	8,85%	-	11,77%
Tracking Error ex-post	0,09%	-	0,11%

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.

* Andere ertragsmindernde Kosten wie individuelle Konto- und Depotgebühren sind in der Darstellung nicht berücksichtigt. Die angegebene Wertentwicklung deckt für jedes Kalenderjahr vollständige 12-Monats-Zeiträume ab. **Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für den künftigen Wertverlauf**. Der Wert der Anlagen kann in Abhängigkeit von der Marktentwicklung steigen oder fallen. Quelle : Amundi.

AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA - UCITS ETF DR - EUR

MONATLICHES FACTSHEET
31/01/2020

WERBUNG

Index-Daten

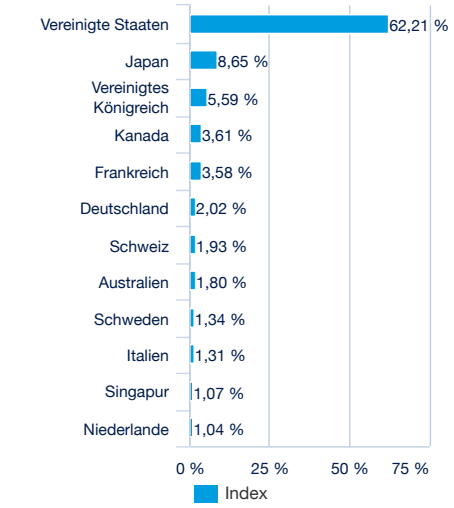
Beschreibung

Der Index bildet die Performance von vier Unterindizes nach, die unter den „Scientific Beta"-Indizes, die vom Edhec Risk Institute (ERI) in Bezug auf dieses Universum von Industrieländeraktien mittlerer und großer Marktkapitalisierung konzipiert wurden, ausgewählt wurden und gegen sie gewichtet werden. Diese Strategieindizes kombinieren vier Titelauswahlschemata und fünf sogenannte „S"-Strategien.

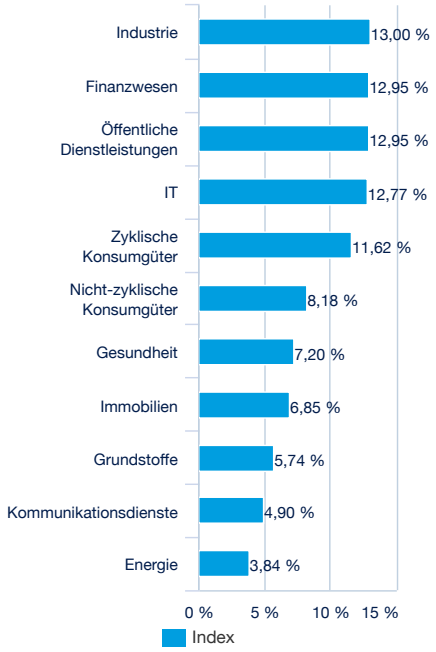
Informationen

Anlageklasse : **Aktien**
Region : **Weltweit**

Aufteilung nach Ländern (Quelle : Amundi)



Aufteilung nach Sektoren (Quelle : Amundi)



Die größten Index-Positionen (Quelle : Amundi)

	% vom Aktiva (Index)
DUKE ENERGY	0,72%
SOUTHERN CO/THE	0,65%
DOMINION ENERGY INC	0,64%
ENTERGY CORP	0,56%
WEC ENERGY GROUP INC	0,44%
AMEREN CORP	0,43%
FIRSTENERGY CORP	0,43%
TARGET CORP	0,42%
CMS ENERGY CORP	0,41%
CONS EDISON INC	0,41%
Summe	**5,11%**

ETF Trading Ansprechpartner (Quelle : Amundi)

Börsenplätze	Handelszeit	Währung	Mnemo	Ticker Bloomberg	INAV Bloomberg	RIC Reuters	INAV Reuters
Nyse Euronext Paris	9:05 - 17:35	EUR	SMRT	SMRT FP	ISMRT	SMRTA.PA	ISMRTINAV.PA
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	SM8T	SM8T GY	ISMRT	SM8T.DE	ISMRTINAV.PA
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	SMRT	SMRT IM	ISMRT	SMRTA.MI	ISMRTINAV

Index-Anbieter

DER HIER GENANNTE Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC (DER „STRATEGIE-INDEX") IST EIGENTUM DER EDHEC RISK INSTITUTE ASIA LTD („ERIA") UND WURDE ZUR VERWENDUNG IN VERBINDUNG MIT DEM AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA IM RAHMEN DER ERI SCIENTIFIC BETA-AKTIVITÄT LIZENZIERT. DER STRATEGIE-INDEX WIRD VON ERI SCIENTIFIC BETA AUF DER GRUNDLAGE DER EDHEC-RISK INSTITUTE-METHODE BERECHNET.
JEDE PARTEI BESTÄTIGT UND ERKLÄRT SICH DAMIT EINVERSTANDEN, DASS DER AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA VON ERIA WEDER GESPONSERT NOCH UNTERSTÜTZT WIRD. ERIA GIBT KEINERLEI ZUSICHERUNG, WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH IMPLIZIT, UND LEHNT HIERMIT AUSDRÜCKLICH JEGLICHE GARANTIEN (INSBESONDERE FÜR DIE MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINSATZ) HINSICHTLICH DES STRATEGIE-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN AB UND ÜBERNIMMT INSBESONDERE KEINERLEI GARANTIE FÜR DIE QUALITÄT, RICHTIGKEIT UND/ODER VOLLSTÄNDIGKEIT DES STRATEGIE-INDEX ODER DARIN ENTHALTENER DATEN, DIE DURCH DIE NUTZUNG DES STRATEGIE-INDEX UND/ODER DIE ZUSAMMENSETZUNG DES STRATEGIE-INDEX ZU EINEM BESTIMMTEN ZEITPUNKT AN EINEM BESTIMMTEN TAG ODER ANDERWEITIG ERZIELTEN ERGEBNISSE UND/ODER DIE BONITÄT EINER GESELLSCHAFT ODER DIE WAHRSCHEINLICHKEIT DES EINTRETENS EINES KREDITEREIGNISSES ODER EINES VERGLEICHBAREN EREIGNISSES (WIE AUCH IMMER DEFINIERT) HINSICHTLICH EINER VERPFLICHTUNG IN BEZUG AUF DEN STRATEGIE-INDEX ZU EINEM BESTIMMTEN ZEITPUNKT AN EINEM BESTIMMTEN TAG ODER ANDERWEITIG. ERIA HAFTET NICHT (WEDER AUS FAHRLÄSSIGEM NOCH AUS ANDEREM VERHALTEN) GEGENÜBER PARTEIEN ODER ANDEREN PERSONEN FÜR FEHLER IM STRATEGIE-INDEX, UND ERIA IST NICHT VERPFLICHTET, DIE PARTEIEN ODER ANDERE PERSONEN AUF DARIN ENTHALTENE FEHLER HINZUWEISEN. ERIA GIBT KEINERLEI ZUSICHERUNG, WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH IMPLIZIT, HINSICHTLICH DER RATSAMKEIT DES KAUFS ODER VERKAUFS DES AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA, DER FÄHIGKEIT DES STRATEGIE-INDEX ZUR NACHBILDUNG ENTSPRECHENDER MARKTENTWICKLUNGEN ODER ANDERWEITIG IN ZUSAMMENHANG MIT DEM STRATEGIE-INDEX, EINER DIESBEZÜGLICHEN TRANSAKTION, EINEM DIESBEZÜGLICHEN PRODUKT ODER DER ÜBERNAHME DAMIT VERBUNDENER RISIKEN. ERIA IST NICHT VERPFLICHTET, BEI DER ERMITTLUNG, ZUSAMMENSTELLUNG ODER BERECHNUNG DES STRATEGIE-INDEX DIE ANFORDERUNGEN EINER PARTEI ZU BERÜCKSICHTIGEN. WEDER EINE PARTEI, DIE ANTEILE DES AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA KAUFT ODER VERKAUFT, NOCH ERIA HAFTEN GEGENÜBER EINER PARTEI FÜR HANDLUNGEN ODER UNTERLASSUNGEN DURCH ERIA IN VERBINDUNG MIT DER ERMITTLUNG, ANPASSUNG, BERECHNUNG ODER PFLEGE DES STRATEGIE-INDEX.

Amundi Asset Management, SAS (French : Société par Actions Simplifiée) mit einem Kapital von 1 086 262 605 EUR
von der französischen Finanzmarktaufsicht Autorité des Marchés Financiers (AMF) unter der Nummer GP 04000036
zugelassene Portfolioverwaltungsgesellschaft mit Sitz in 90, Bd Pasteur, 75015 Paris, Frankreich 437 574 452 RCS Paris

Wichtige Hinweise

Für den Fonds gibt es einen von der Luxemburger Finanzaufsicht (CSSF) genehmigten Verkaufsprospekt und wesentliche Anlegerinformationen, die vor einer Zeichnung zur Verfügung gestellt werden müssen. Die Verkaufsunterlagen 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 Verkaufsunterlagen der für die Vermarktung in Deutschland registrierten Fonds sind kostenlos und in Papierform in deutscher Sprache erhältlich bei Marcard, Stein & Co. AG, Ballindamm 36, 20095 Hamburg, Deutschland. 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 finden Sie in den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) und im Verkaufsprospekt des betreffenden Fonds, die Sie vor einer Anlageentscheidung lesen sollten. 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 Aussagen vornehmen zu können. Dieses Dokument ist Werbung und stellt keine Anlageempfehlung dar. 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 (z.B. an Börsen) 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. Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge fallen nur an, wenn Anteile direkt bei der Fondsgesellschaft gezeichnet oder bei dieser zurückgenommen werden. Sie finden keine Anwendung, wenn Anleger solche Anteile an Börsen kaufen oder verkaufen. Anleger, die an der Börse handeln, zahlen die von ihren Börsenmaklern erhobenen Gebühren. Informationen zu solchen Gebühren sind bei Börsenmaklern erhältlich. Autorisierte Teilnehmer, die direkt mit dem Fonds handeln, zahlen entsprechende Transaktionskosten.