

# Lyxor NASDAQ-100 UCITS ETF

## 1. INFORMATIONS SUR LE FONDS

### Description

Lyxor Asset Management Group ("Lyxor") a été fondé en 1998 et se compose de 2 filiales (1) (2) du groupe Société Générale. Lyxor s'appuie sur l'expertise de 600 professionnels à travers le monde gérant et conseillant €117,6Mds\* d'actifs. Lyxor offre des services sur-mesure de gestion d'actifs s'appuyant sur ses expertises en ETF & gestion indicielle, Gestion Alternative & Multi-Gestion et en Performance Absolue & Solutions. Parmi les acteurs les plus expérimentés du marché, Lyxor ETF est le troisième fournisseur d'ETF en Europe (deuxième en termes de liquidité (3)), avec un encours sous gestion de plus de €49,8Mds\*. Avec 220 ETF cotés sur 13 places financières, Lyxor ETF met à la disposition des investisseurs des solutions d'investissement variées visant à diversifier leur allocation à travers l'ensemble des classes d'actifs (actions, obligations, marchés monétaires, matières premières via des instruments financiers à terme). Preuve de son engagement pour la qualité des ETF, Lyxor ETF a mis en place depuis 2011 une charte de qualité, permettant de veiller à ce que chaque ETF réponde aux exigences les plus strictes en matière de qualité de réplcation, de suivi des risques, de liquidité et de transparence. [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com)

### Objectif d'investissement

Le Lyxor NASDAQ-100 UCITS ETF est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence NASDAQ-100 Notional Net Total Return Index. L'indice NASDAQ-100 Notional Net Total Return Index est composé des 100 principales valeurs non financières, nationales et internationales listées sur le Nasdaq, selon leur capitalisation boursière. La méthodologie de l'indice est disponible sur [www.nasdaq.com](http://www.nasdaq.com)

### Facteurs de risque

Il est important que les investisseurs potentiels évaluent les risques décrits ci-dessous et dans le prospectus du fonds, disponible sur [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com)

**RISQUE EN CAPITAL :** Les ETF sont des instruments de réplcation : leur profil de risque est similaire à celui d'un investissement direct dans l'indice sous-jacent. Le capital des investisseurs est entièrement risqué et il se peut que ces derniers ne récupèrent pas le montant initialement investi.

**RISQUE DE REPLICATION :** Les objectifs du fonds peuvent ne pas être atteints si des événements inattendus surviennent sur les marchés sous-jacents et ont un impact sur le calcul de l'indice et l'efficacité de la réplcation du fonds.

**RISQUE DE CONTREPARTIE :** Les investisseurs sont exposés aux risques découlant de l'utilisation d'un Swap de gré à gré avec la Société Générale. Conformément à la réglementation OPCVM, l'exposition à la Société Générale ne peut pas dépasser 10% des actifs totaux du fonds.

**RISQUE DU SOUS-JACENT :** L'indice sous-jacent d'un ETF Lyxor peut être complexe et volatil. Dans le cas des investissements en matières premières, l'indice sous-jacent est calculé par rapport aux contrats futures sur matières premières, ce qui expose l'investisseur à un risque de liquidité lié aux coûts, par exemple de portage et de transport. Les ETF exposés aux Marchés émergents comportent un risque de perte potentielle plus élevé que ceux qui investissent dans les Marchés développés, car ils sont exposés à de nombreux risques imprévisibles inhérents à ces marchés.

**RISQUE DE CHANGE :** Les ETF peuvent être exposés au risque de change s'ils sont libellés dans une devise différente de celle de l'indice sous-jacent qu'ils réplcient. Cela signifie que les fluctuations des taux de change peuvent avoir un impact positif ou négatif sur les rendements.

**RISQUE DE LIQUIDITE :** La liquidité est fournie par des teneurs de marché enregistrés sur les bourses où les ETF sont cotés, y compris la Société Générale. La liquidité sur les bourses peut être limitée du fait d'une suspension du marché sous-jacent représenté par l'indice sous-jacent suivi par l'ETF, d'une erreur des systèmes de l'une des bourses concernées, de la Société Générale ou d'autres teneurs de marché, ou d'une situation ou d'un événement exceptionnel(les).

Ticker: UST FP

Ticker	UST FP
Enveloppe juridique	FCP de droit français
UCITS	Oui
ISIN	FR0007063177
PEA	Non
Méthode de réplcation	Indirecte (via un swap)
Pleine propriété des actifs	Oui
Devise de Référence	EUR
Date de Lancement	06/09/2001
VL de lancement (EUR)	7,88
TFE (frais/an)	0,30%
Risque de change	Oui
Valeur Liquidative (EUR)	21,79
Actif Net de la part (M EUR)	545,74
Actif Net du Fonds (M EUR)	545,74
Investissement minimal (part)	1
Affectation des résultats	Distribution
Date en cas de distribution	Décembre
Valeur du dernier détachement (EUR)	0,15

### Informations sur les cotations

Place	Horaires (GMT)	Devise	Code Bloomberg	RIC Reuters
NYSE Euronext Paris*	08:00 / 16:30	EUR	UST FP	USTE.PA
Borsa Italiana (Milano)	08:00 / 16:30	EUR	UST IM	USTE.MI
Deutsche Boerse (Xetra)	08:00 / 19:00	EUR	LYMS GY	USTE.DE
Bolsa de Madrid	08:00 / 16:30	EUR	UST SM	USTE.MC
LSE	08:00 / 16:30	USD	NASD LN	NASD.L
LSE	08:00 / 16:30	GBP	NASL LN	NASL.L

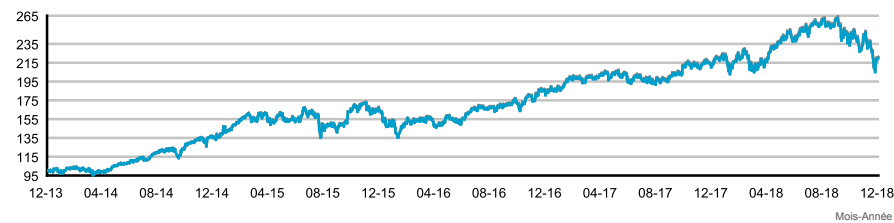
\* Première place de cotation pour cette classe de parts

Nom	NASDAQ-100 Notional Net Total Return Index	
Exposition		Amérique du Nord
Classe d'actifs		Actions
Type		Net Total Return
Devise		USD
RIC Reuters		.XNDXNRR
Code Bloomberg de l'indice		XNDXNRR
Informations complémentaires		<a href="http://www.nasdaq.com">www.nasdaq.com</a>
Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 31 décembre 2018		

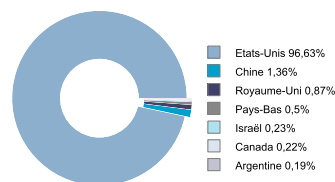
## 2. Information sur l'indice

Performance en base 100

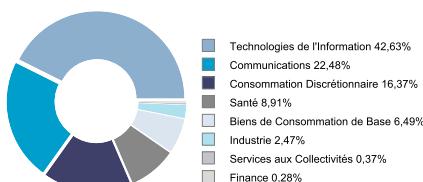
Source : Bloomberg, Lyxor AM, au 31 décembre 2018



### Allocation géographique de l'indice



### Allocation sectorielle de l'indice



## 3. Performances ETF

### Lyxor NASDAQ-100 UCITS ETF

	1 mois	3 mois	6 mois	3 ans	5 Ans
Benchmark (EUR)	-9,74%	-15,53%	-7,87%	33,83%	119,70%
Ecart de Performance	-0,01%	-0,03%	-0,05%	-0,33%	-1,60%

### Lyxor NASDAQ-100 UCITS ETF

	YTD	2017	2016	2015	2014
Benchmark (EUR)	4,63%	16,36%	9,93%	21,52%	35,09%
Ecart de Performance	-0,11%	-0,04%	-0,11%	-0,27%	-0,35%
Tracking Error	-	0,00%	0,01%	0,02%	0,02%

### Lyxor NASDAQ-100 UCITS ETF

	31/12/2018	29/12/2017	30/12/2016	31/12/2015	31/12/2014	31/12/2013
Benchmark (EUR)	4,63%	16,36%	9,93%	21,52%	35,09%	
Ecart de Performance	-0,11%	-0,04%	-0,11%	-0,27%	-0,35%	

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 31 décembre 2018

LES STATISTIQUES DE PERFORMANCE/SIMULATIONS DE PERFORMANCES/PERFORMANCE ET DE SIMULATIONS DE PERFORMANCES CORRESPONDENT À DES PÉRIODES PASSÉES ET NE CONSTITUENT PAS DES INDICATEURS FIAIBLES DES RÉSULTATS FUTURS. CE CI VAUT ÉGALEMENT POUR LES DONNÉES DE MARCHÉ HISTORIQUES.

### Dix principales valeurs

Microsoft Corp	10,14%
Apple Inc	9,73%
Amazon.Com Inc	9,55%
Alphabet Inc-CI C	4,74%
Alphabet Inc-CI A	4,18%
Facebook Inc-A	4,13%
Intel Corp	3,09%
Cisco Systems Inc	2,81%
Pepsico Inc	2,28%
Comcast Corp-Class A	2,23%

Les performances des ETF de distribution sont calculées en réinvestissant les dividendes dans la performance de l'ETF. L'écart de performance représente les différences de performance entre l'ETF et l'indice. La Tracking Error représente la volatilité annualisée des différences de performance entre l'ETF et l'indice de référence.

L'indice de référence peut être modifié. Nous utiliserons les indices suivants pour comparer la performance de l'ETF par rapport à son indice de référence :

	Du	Au
MSCI US/IT	07/09/2001	26/09/2006
NASDAQ-100	26/09/2006	21/03/2012
NASDAQ-100 Notional Net Total Return Index	21/03/2012	

Ecart de Performance = Perf Simulée - [(1+Perf Indice) / (1+Perf taux de change) - 1]

Depuis le lancement

Ratio de Sharpe 0,23

**NOTICE POUR L'INVESTISSEUR**

\*\*\*The Total Expense Ratio (TER) covers all costs incurred by the Management Company to manage the underlying assets. It comprises a Management Fee and Structural Costs described as follows. The Management Fee represents the compensation for the Management Company services. The Structural Costs represent the custodian fee, the administrative fee, the audit fee and all other operating costs that will be paid by the Management Company to operate the funds.

Le présent document est un document à caractère promotionnel et non de nature réglementaire.

Il appartient à chaque investisseur de s'assurer qu'il est autorisé à souscrire ou à investir dans ce produit.

Avant tout investissement dans ce produit, les investisseurs sont invités à se rapprocher de leurs conseils financiers, fiscaux, comptables et juridiques.

LYXOR NASDAQ-100 UCITS ETF est un Fonds commun de placement (FCP) de droit français agréé par l'Autorité des marchés financiers (AMF), conformément aux dispositions de la Directive UCITS (2009/65/EC).

Société Générale et Lyxor International Asset Management (« Lyxor AM »), recommandent aux investisseurs de lire attentivement la rubrique « Profil de risque » du prospectus et la rubrique « Profil de risque et de rendement » du Document d'information clé pour l'investisseur du produit (DICI). Le DICI en langue française, ainsi que le prospectus en langue française, peuvent être obtenus gratuitement sur [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com) ou auprès de [client-services-etf@lyxor.com](mailto:client-services-etf@lyxor.com).

Le produit fait l'objet de contrats d'animation qui visent à assurer la liquidité du produit sur Euronext Paris, dans des conditions normales de marché et de fonctionnement informatique.

Les parts ou actions de l'OPCVM coté (« UCITS ETF ») acquises sur le marché secondaire ne peuvent généralement pas être directement revendues à l'OPCVM coté. Les investisseurs doivent acheter et vendre les parts/actions sur un marché secondaire avec l'assistance d'un intermédiaire (par exemple un courtier) et peuvent ainsi supporter des frais. En outre, il est possible que les investisseurs paient davantage que la valeur nette d'inventaire actuelle lorsqu'ils achètent des parts / actions et reçoivent moins que la valeur nette d'inventaire actuelle à la revente.

La composition actualisée du portefeuille d'investissement du produit est mentionnée sur le site [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com). En outre la valeur liquidative indicative figure sur les pages Reuters et Bloomberg du produit et peut également être mentionnée sur les sites internet des places de cotation du produit.

Il n'y a aucune garantie que l'objectif du fonds soit atteint. Le fonds peut ne pas toujours être en mesure de répliquer parfaitement la performance de l'indice.

**Le produit présente un risque de perte en capital.** La valeur de remboursement du produit peut être inférieure au montant de l'investissement initial. Dans le pire des scénarii, les investisseurs peuvent perdre jusqu'à la totalité de leur

investissement. L'indice mentionné dans le présent document (« Indice ») n'est ni parrainé, ni approuvé, ni vendu par Société Générale, Lyxor AM. Ni Société Générale, ni Lyxor AM n'assumeront une quelconque responsabilité à ce titre.

L'exactitude, l'exhaustivité ou la pertinence de l'information provenant de sources externes n'est pas garantie, bien qu'elle ait été obtenue auprès de sources raisonnablement jugées fiables. Sous réserve des lois applicables, Société Générale,

Lyxor AM et n'assument aucune responsabilité à cet égard.

Les éléments du présent document relatifs aux données de marchés sont fournis sur la base de données constatées à un moment précis et qui sont susceptibles de varier.

**LE PRESENT DOCUMENT NE CONSTITUE PAS UNE OFFRE DE VENTE DE TITRES AUX ETATS-UNIS D'AMERIQUE. LE PRODUIT QUI Y EST DECRIT NE SERA PAS ENREGISTRE EN VERTU DU U.S. SECURITIES ACT DE 1933, TEL QUE MODIFIE (LE « U.S. SECURITIES ACT ») ET NE PEUT ETRE NI OFFERT, NI CEDE AUX ETATS-UNIS D'AMERIQUE, SANS AVOIR ETE PREALABLEMENT ENREGISTRE OU EXEMPTÉ D'ENREGISTREMENT EN VERTU DU U.S. SECURITIES ACT.**