

Lyxor MSCI Russia UCITS ETF - Acc

Ticker: RUS FP

1. INFORMATIONS SUR LE FONDS

Description

Lyxor Asset Management Group ("Lyxor") a été fondé en 1998 et se compose de 2 filiales (1) (2) 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 réplication, de suivi des risques, de liquidité et de transparence. www.lyxoretf.com

Objectif d'investissement

Le Lyxor MSCI Russia UCITS ETF - Acc est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence MSCI Russia IMI Select GDR Net Total Return USD Index augmentée des éventuels dividendes payés par les actions constituant l'indice. L'indice MSCI Russia IMI Select GDR Net Total Return USD Index est un indice qui mesure la performance des 85% des GDR traités sur le London Stock Exchange, ayant la capitalisation flottante la plus importante. L'indice est pondéré par la capitalisation flottante de chaque GDR. La méthodologie complète de construction de l'indice est disponible sur www.djindexes.com. Une exposition aux "DRS" entraîne un risque supplémentaire comparé à un investissement direct sur les actions russes sous-jacentes.

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

RISQUE EN CAPITAL : Les ETF sont des instruments de réplication : 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 réplication 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 contrepartie 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 répliquent. 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. 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, des teneurs de marché, ou d'une situation ou d'un événement exceptionnel(le).

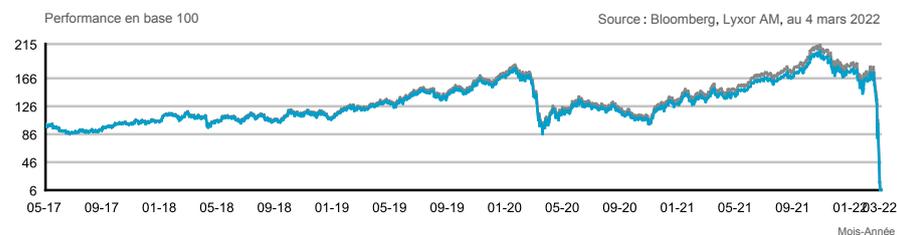
Ticker	RUS FP
Enveloppe juridique	SICAV
UCITS	Oui
ISIN	LU1923627092
PEA	Non
Méthode de réplication	Indirecte (via un swap)
Pleine propriété des actifs	Oui
Devise de Référence	EUR
Date de Lancement	19/06/2006
VL de lancement (EUR)	35,2533
TFE (frais/an)	0,00%
Risque de change	Oui
Valeur Liquidative (EUR)	1,92
Actif Net de la part (M EUR)	12,50
Actif Net du Fonds (M EUR)	13,63
Encours SICAV (M EUR)	58 790,27
Investissement minimal (part)	1
Affectation des résultats	Capitalisation

Informations sur les cotations

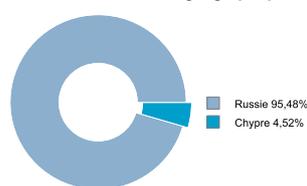
Place	Horaires (GMT)	Devise	Code Bloomberg	RIC Reuters
XETRA*	08:00 / 16:30	EUR	LRUS GY	LRUS.DE
SIX Swiss Exchange	08:00 / 16:20	USD	LYRUS SW	LYRUS.S
NYSE Euronext Paris	08:00 / 16:30	EUR	RUS FP	LRUS.PA
Borsa Italiana (Milano)	08:00 / 16:30	EUR	RUS IM	LRUS.MI

* Première place de cotation pour cette classe de part

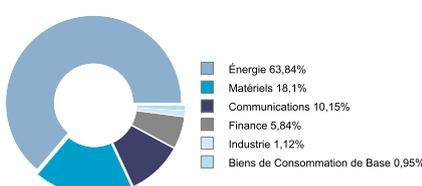
2. Information sur l'indice



Allocation géographique de l'indice



Allocation sectorielle de l'indice



Nom	MSCI Russia IMI Select GDR Net Total Return USD Index
Exposition	Europe de l'Est
Classe d'actifs	Actions
Type	Net Total Return
Devise	USD
RIC Reuters	.dMIRU000IONUS
Code Bloomberg de l'indice	NU716854
Informations complémentaires	www.msci.com

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 4 mars 2022

Dix principales valeurs

Gazprom Oao-Spon ADR	40,74%
Mmc Norilsk Nickel Pjsc	14,17%
Sistema Jsc-Reg S Spons Gdr	9,00%
Rosneft Ojsc-Reg S Gdr	8,31%
Tatneft Pao	6,57%
Tcs Group Holding-Gdr Reg S	4,52%
Surgutneftegas-Sp ADR	3,98%
Lukoil Pjsc	3,54%
Polyus Pjsc-Reg Gdr	3,14%
Sberbank-Sponsored ADR/GDR	1,32%

3. Performances ETF

1 mois 3 mois 6 mois 3 ans 5 ans 10 ans

	YTD	2021	2020	2019	2018
Lyxor MSCI Russia UCITS ETF - Acc	-	39,31%	-23,43%	53,10%	5,52%
Benchmark	-	40,50%	-22,42%	54,85%	6,58%
Ecart de Performance	-	-1,18%	-1,01%	-1,74%	-1,06%
Tracking Error	-	0,07%	0,19%	0,07%	0,06%

	30/04/2021	30/04/2020	30/04/2019	30/04/2018
Lyxor MSCI Russia UCITS ETF - Acc	-	19,23%	-9,35%	23,58%
Benchmark	-	20,63%	-8,22%	24,83%
Ecart de Performance	-	-1,40%	-1,13%	-1,24%

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 4 mars 2022

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

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
DJ RusIndex Titans 10	19/06/2006	21/03/2012
Dow Jones Russia GDR USD	21/03/2012	04/12/2018
MSCI Russia IMI Select GDR Net Total Return USD Index	04/12/2018	

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

**Jusqu'au 14/03/2019 l'historique des performances du fonds Lyxor MSCI Russia UCITS ETF correspond aux performances de Lyxor MSCI Russia UCITS ETF OLD. Ce fonds a été absorbé par Lyxor MSCI Russia UCITS ETF le 14/03/2019.

	Depuis le lancement			
	1Y	3Y	5Y	10Y
Ratio de Sharpe	-	-	-	-
Volatilité du Fonds	-	-	-	-
Volatilité de l'Indice	-	-	-	-
Ratio de Sharpe	-	-	-	-
Tracking Error	-	-	-	-

INFORMATIONS IMPORTANTES POUR LES INVESTISSEURS

Les Parties concluant des transactions (telles qu'une transaction de financement ou une opération sur instrument dérivé) ou investissant dans des instruments financiers recourant à un indice ou un taux d'intérêt variable (référentiel) sont exposées au risque que le référentiel :

- (1) puisse faire l'objet de changements méthodologiques ou autres de nature à affecter la valeur de la transaction en question ; ou
- (2) (i) devienne non conforme aux législations et réglementations applicables (telles que le Règlement sur les indices de référence européen), (ii) cesse d'être publié (possibilité d'une cessation de la publication du taux LIBOR et cessation prévue de la publication du taux EONIA à partir de décembre 2021), ou (iii) que l'autorité de supervision ou l'administrateur du référentiel en question produise une déclaration selon laquelle le référentiel n'est plus représentatif et qu'en conséquence, il soit remplacé par un autre référentiel, ce qui peut avoir un impact négatif important sur les variables économiques des transactions en question.

Il vous appartient de réaliser indépendamment vos propres recherches et analyses des conséquences potentielles de tous les risques applicables, tels que ceux susmentionnés, notamment au regard des initiatives lancées dans le secteur en matière de développement de taux de référence alternatifs et des versions actualisées de la documentation de marché standard concernée.

NOTICE POUR L'INVESTISSEUR

** Le total des frais sur encours (Total Expense Ratio ou TER) couvre l'ensemble des frais engagés par la Société de gestion pour gérer les actifs sous-jacents. Il inclut une Commission de gestion et les Frais structurels tels que décrits ci-après. La Commission de gestion représente la rémunération de la Société de gestion pour les services qu'elle preste. Les Frais structurels comprennent les frais de garde, administratifs, d'audit et tous autres frais opérationnels qui seront engagés par la Société de gestion dans le cadre de la gestion des fonds.

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 MSCI Russia UCITS ETF est une SICAV de droit luxembourgeois inscrite sur la liste officielle des organismes de placement collectifs soumis à la surveillance de la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) au titre de la Partie I de la loi du 17 décembre 2010, conformément aux dispositions de la Directive UCITS (2009/65/EC).

Le produit est un compartiment de Lyxor MSCI Russia UCITS ETF a obtenu l'agrément de la CSSF et a fait l'objet d'une notification auprès de l'Autorité des Marchés Financiers en vu de sa commercialisation sur le territoire français.

Amundi Asset Management (« Amundi AM ») et Lyxor International Asset Management S.A.S. 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 (DIIC). Le DIIC en langue française, ainsi que le prospectus en langue anglaise, peuvent être obtenus gratuitement sur www.lyxoretf.com ou auprès de client-services-etf@lyxor.com.

L'attention de l'investisseur est attirée sur le fait que le prospectus n'est disponible qu'en version anglaise.

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. 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 (l'« Indice ») n'est ni parrainé, ni approuvé, ni vendu par Amundi Asset Management (« Amundi AM »), Lyxor AM. Ni Amundi AM, 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, Amundi AM, 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.