

Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF - Acc

REPORTING

Communication Publicitaire

31/08/2022

OBLIGATAIRE

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **103,65 (EUR)**
 Date de VL et d'actif géré : **31/08/2022**
 Actif géré : **646,86 (millions EUR)**
 Code ISIN : **LU1829219713**
 Type de Réplication : **Physique**
 Indice de référence :
**100% FTSE EUROZONE HIGHEST RATED
 MACRO-WEIGHTED GOVERNMENT BOND 3-5Y
 (MID PRICE) INDEX**
 Eligibilité : **Compte-titres, Assurance-vie**
 Date de la première VL : **25/11/2011**
 VL de lancement : **100,00 (EUR)**

Objectif d'investissement

Le Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF - Acc est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted 3-5 (EUR).

Profil de risque et de rendement (SRRI) (Source : Fund Admin)



1 A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

2 A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

Le SRRI correspond au profil de risque et de rendement présent dans le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (DICI). La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Il n'est pas garanti et pourra évoluer dans le temps.

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 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.

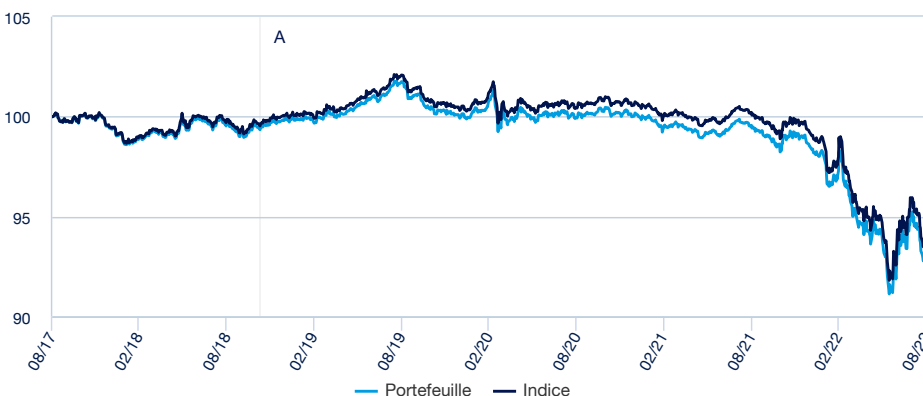
- **RISQUE DE CHANGE** : Les ETF peuvent être exposés au risque de change s'ils sont libellés dans une devise différente de celle de l'Indice sous-jacent qu'ils répliquent. Cela signifie que les fluctuations des taux de change peuvent avoir un impact positif ou négatif sur les rendements.

- **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).

« Les valeurs liquidatives techniques peuvent être calculées et publiées tout jour civil (à l'exception des samedis et des dimanches) qui ne soit ni un jour ouvré ni un jour de transaction. Ces valeurs liquidatives techniques n'ont qu'une valeur indicative et ne serviront pas de base pour l'achat, la conversion, le rachat et/ou le transfert d'actions. »

Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

Evolution de la performance (VL) * (Source : Fund Admin)



A : Until 08/11/2018, the performance of the Fund indicated corresponds to that of the sub-funds of MULTI UNITS France - Lyxor EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF (the Absorbed fund). The latter was absorbed by the Fund on 08/11/2018.

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
30/12/2021	29/07/2022	31/05/2022	31/05/2022	31/08/2021	30/08/2019	31/08/2017	31/08/2012
Portefeuille	-6,66%	-3,26%	-1,89%	-7,52%	-9,63%	-8,05%	-2,67%
Indice	-6,61%	-3,25%	-1,87%	-7,41%	-9,24%	-7,35%	-1,17%
Ecart	-0,06%	-0,02%	-0,02%	-0,10%	-0,39%	-0,70%	-1,50%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
Portefeuille	-1,66%	0,27%	0,12%	0,38%	-1,00%	1,40%	0,56%	3,97%	-0,50%	4,62%
Indice	-1,53%	0,44%	0,29%	0,54%	-0,85%	1,57%	0,72%	4,11%	-0,34%	4,79%
Ecart	-0,14%	-0,17%	-0,17%	-0,17%	-0,15%	-0,16%	-0,16%	-0,14%	-0,16%	-0,17%

* Source : Amundi. Les performances ci-dessus couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile. Les performances passées ne préjugent en rien des résultats actuels et futurs et ne sont pas garanties des rendements à venir. Les gains ou pertes éventuels ne prennent pas en compte les frais, commissions et redevances éventuels supportés par l'investisseur lors de l'émission et du rachat des parts (ex : taxes, frais de courtage ou autres commissions prélevés par l'intermédiaire financier...). Si les performances sont calculées dans une devise autre que l'euro, les gains ou les pertes éventuellement générés peuvent de ce fait être impactés par les fluctuations des taux de change (à la hausse comme à la baisse). L'écart correspond à la différence de performance du portefeuille et de l'Indice.

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin) *

	1 an	3 ans
Volatilité du portefeuille	4,55%	2,90%
Volatilité de l'indice	4,54%	2,90%
Tracking Error ex-post	0,02%	0,02%
Ratio de Sharpe	-1,39	-0,88

* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an. La Tracking Error représente la volatilité annualisée des différences de performance entre l'ETF et l'Indice de référence

OBLIGATAIRE ■

Description de l'indice

L'indice MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted 3-5 (EUR) mesure la performance du segment des Obligations d'Etat notées AAA et AA de la zone euro avec une pondération par pays calculée sur la base d'indicateurs macroéconomiques. Les obligations admissibles à la composition de l'indice MTS Mid Price Highest Rated Macro-Weighted 3-5 (EUR) doivent être cotées sur la plateforme MTS et émises par les Etats de la zone euro.

Données du portefeuille (Source : Amundi)

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Obligataire**
Exposition : **Zone Euro**

Nombre de valeurs du portefeuille : **31**

Indicateurs du portefeuille (Source : Fund Admin)

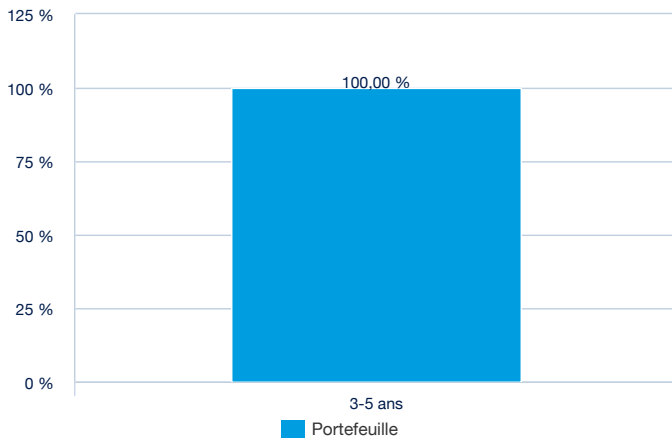
	Portefeuille
Sensibilité ¹	3,87
Notation Moyenne ²	AA+
Taux de rendement	1,29%

¹ La sensibilité (en points) représente le changement en pourcentage du prix pour une évolution de 1% du taux de référence

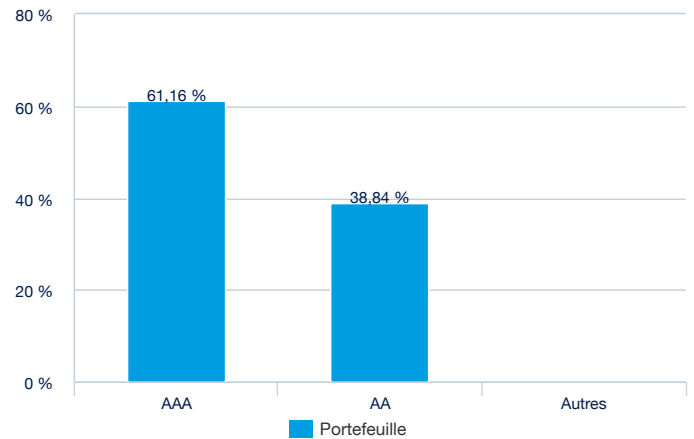
² Basée sur les obligations et les CDS mais tout autre dérivé exclu.

Répartition du portefeuille (Source : Amundi)

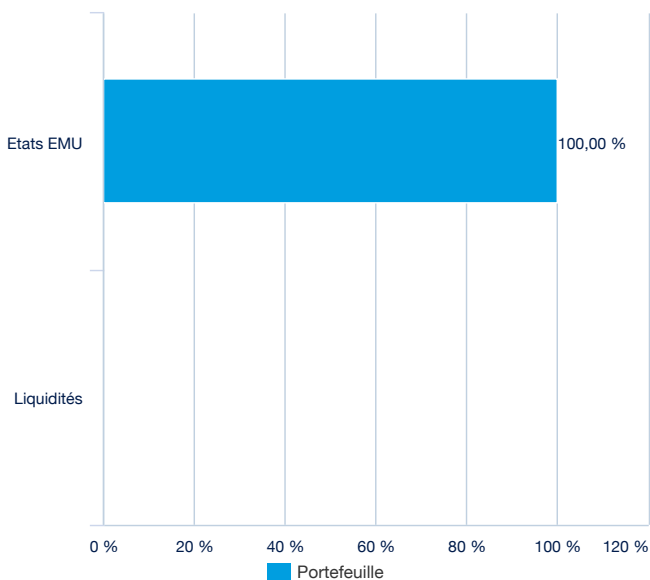
Par maturité (source : Amundi)



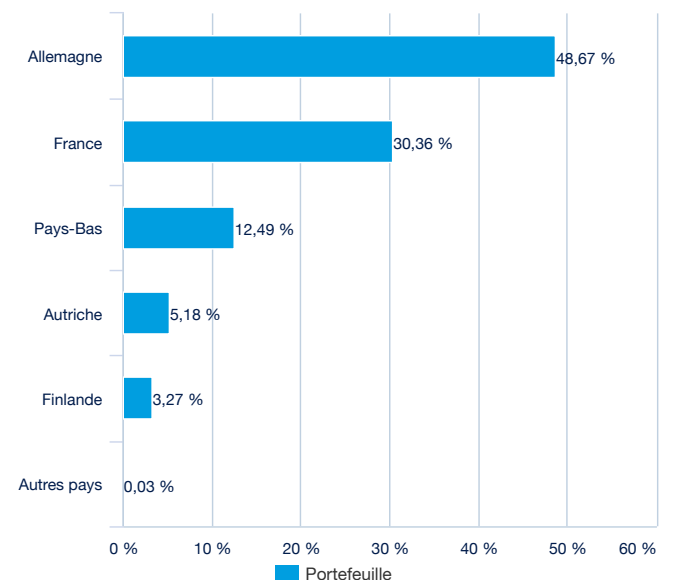
Par notation (source : Amundi)



Par type d'émetteur (source : Amundi)



Par pays (source : Amundi)



OBLIGATAIRE ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme Juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Asset Management
Valorisateur	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Dépositaire	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG
Date de création de la classe	08/11/2018
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU1829219713
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,17% (prélevés) - 22/02/2022
Frais d'entrée (maximum)	0,05%
Frais de sortie (maximum)	0,05%
Clôture fiscale	Décembre

Données de cotation de l'ETF (source : Amundi)

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Berne Exchange	9:00 - 17:30	EUR	MA35	LYMA35 BW	AAA35IV	LYMA35.BNS	AAA35IV
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	MA35	MA35 FP	AAA35IV	MA35.PA	AAA35IV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	MA35	LYS5 GY	AAA35IV	LYS5.DE	AAA35IV
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	MA35	AAA35 IM	AAA35IV	AAA35.MI	AAA35IV

Contact

Contact ETF vente

PAYS	N° de téléphone	E-mail	Site
Royaume-Uni	+44 (0)800-70 6956	info@lyxoretf.co.uk	www.lyxoretf.uk
Pays-Bas	+44 (0)800-70 6956	info@lyxoretf.co.uk	www.lyxoretf.nl
Autriche	+49 (0)69 717 4444	info@lyxoretf.at	www.lyxoretf.at
Allemagne	+49 (0)69 717 4444	info@lyxoretf.de	www.lyxoretf.de
Belgique	+ (0)800 - 10 880	info@lyxoretf.be	www.lyxoretf.be
Suisse	+41 (0)58 272 33 44	info@lyxoretf.ch	www.lyxoretf.ch
Danemark	+44 (0)800-707 6956	info@lyxoretf.dk	www.lyxoretf.dk
Finlande	+44 (0)800-707 6956	info@lyxoretf.fi	www.lyxoretf.fi
Espagne	+900 900 009	info@lyxoretf.es	www.lyxoretf.es
Singapour & Hong-Kong & Japon	+65 6423 2638	info@lyxoretf.com.sg	www.lyxoretf.com.sg
Italie	+800 92 93 00	info@lyxoretf.it	www.lyxoretf.it
Norvège	+44 (0)800-707 6956	info@lyxoretf.no	www.lyxoretf.no
Suède	+44 (0)800-707 6956	info@lyxoretf.se	www.lyxoretf.se
France	+(0) 33 01 42 13 96 97	info@lyxoretf.fr	www.lyxoretf.fr

Contact ETF Courtiers

SG CIB	+33 (0)1 42 13 38 63
BNP Paribas	+44 (0) 207 595 1844

Contact Lyxor

Lyxor ETF
91-93 bd Pasteur
CS 21564
75 730 Paris Cedex 15 - France
Hotline : +33 (0)1 42 13 42 14
Client-services-etf@lyxor.com

OBLIGATAIRE ■

Fournisseurs d'indices

Le compartiment n'est en aucune façon garanti, recommandé, vendu ou promu par FTSE International Limited (« FTSE») ou les sociétés du London Stock Exchange Group (« LSEG ») (collectivement, les « Parties associées au Concédant ») et aucune Partie associée au Concédant ne formule la moindre affirmation, prévision ou déclaration ni ne donne de garantie de quelque sorte que ce soit, expresse ou tacite, quant (i) aux résultats qui seront obtenus en utilisant l'Indice (sur lequel se fonde le Compartiment), (ii) au niveau de l'Indice à tout moment ou jour particulier, ou autre, ou (iii) à l'adéquation de l'Indice à la finalité pour laquelle il est associé au Compartiment.

Aucune des Parties associées au Concédant n'a fourni ni ne fournira de conseils ou recommandations financiers ou d'investissement concernant l'Indice à la Société de gestion ou à ses clients. L'Indice est calculé par FTSE ou par son agent. Aucune Partie associée au Concédant (a) ne pourra être tenue responsable (que ce soit par négligence ou pour toute autre raison) à l'égard de quiconque pour toute erreur dans l'Indice ou (b) n'aura d'obligation d'en informer quiconque.

Tous les droits sur l'Indice sont dévolus à FTSE. « FTSE® » est une marque de LSEG utilisée par FTSE sous licence.

Avertissement

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 EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) 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 EuroMTS Highest Rated Macro-Weighted Govt Bond 3-5Y (DR) UCITS ETF qui 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 ») recommande 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 anglaise, peuvent être obtenus gratuitement sur info@amundiETF.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 »). Amundi AM n'assumera 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 n'assume 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 ETEPREALABLEMENT ENREGISTRE OU EXEMPTÉ D'ENREGISTREMENT EN VERTU DU U.S. SECURITIES ACT.