

## Lyxor US Curve Flattening 2-10 UCITS ETF - Acc

### 1. INFORMATIONS SUR LE FOND

Ticker: **FLTU FP**

#### Objectif d'investissement

Le Lyxor US Curve Flattening 2-10 UCITS ETF - Acc est un ETF (exchange traded fund) conforme à la Directive UCITS. Il a pour objectif de répliquer, à la hausse comme à la baisse, l'indice Solactive USD Daily (x7) Flattener 2-10 Index. Cet indice reproduit la performance d'une stratégie systématique dont les rendements sont directement liés aux évolutions de la courbe des taux des Bons du Trésor américain. L'indice est construit de telle façon que, pour une baisse de 1 point de base dans la pente de la courbe, l'indice devrait progresser de 7 points de base environ. Des facteurs de marché peuvent toutefois causer une certaine déviation. L'indice est constitué de deux poches : une position short sur les 2Y US Treasury Bond Futures et une position longue sur les 10Y US Treasury Ultra Bond Futures. La méthodologie de l'indice est disponible sur [www.solactive.com](http://www.solactive.com).

Les ETF Lyxor sont des fonds d'investissement cotés en bourse qui procurent une exposition fidèle et bon marché à un indice de référence.

#### Informations sur les cotations

| Place                   | Horaires (GMT) | Devise | Code Bloomberg | RIC Reuters | Distribution |
|-------------------------|----------------|--------|----------------|-------------|--------------|
| NYSE Euronext Paris*    | 08:00 / 16:30  | EUR    | FLTU FP        | FLTU.PA     | Non          |
| Deutsche Boerse (Xetra) | 08:00 / 19:00  | EUR    | FLTU GY        | FLTU.DE     | Non          |
| Borsa Italiana (Milano) | 08:00 / 16:30  | EUR    | FLTU IM        | FLTU.MI     | Non          |
| LSE                     | 08:00 / 16:30  | USD    | FLTU LN        | FLTU.L      | Non          |
| BERNE STOCK EXCHANGE    | 08:00 / 16:30  | CHF    | FLTU BW        | FLTU.BN     | Non          |

\* Première place de cotation pour cette classe de parts

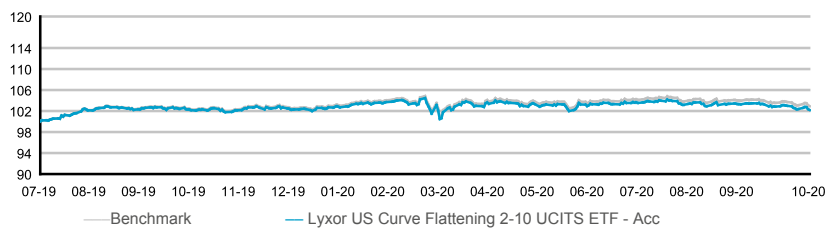
#### Caractéristiques Principales du Fonds

|                               |                         |
|-------------------------------|-------------------------|
| Ticker                        | FLTU FP                 |
| Enveloppe juridique           | SICAV                   |
| Domiciliation                 | Luxembourg              |
| UCITS                         | Oui                     |
| ISIN                          | LU2018761762            |
| PEA                           | Non                     |
| Méthode de réplcation         | Indirecte (via un swap) |
| Prêt de titres                | Non                     |
| Pleine propriété des actifs   | Oui                     |
| Devise de Référence           | USD                     |
| Date de Lancement             | 18/07/2019              |
| VL de lancement (USD)         | 100                     |
| TFE (frais/an)                | 0,30%                   |
| Risque de change              | Oui                     |
| Valeur Liquidative (USD)      | 102,18                  |
| Actif Net de la part (M USD)  | 0,66                    |
| Actif Net du Fonds (M USD)    | 0,66                    |
| Encours SICAV (M USD)         | 41 286,34               |
| Investissement minimal (part) | 1                       |
| Affectation des résultats     | Capitalisation          |

Source: Lyxor AM, 30 octobre 2020

### 2. Information sur l'indice

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 30 octobre 2020



|                              |  |
|------------------------------|--|
| Nom                          | Solactive USD Daily (x7) Flattener 2-10 Index            |
| Exposition                   | USA  |
| Classe d'actifs              | Obligations  |
| Type                         | Net Total Return   |
| Devise                       | USD  |
| RIC Reuters                  | -  |
| Code Bloomberg de l'indice   | S0UD7FTT   |
| Informations complémentaires | <a href="http://www.solactive.com">www.solactive.com</a> |

### 3. Performances ETF

|  | 1 mois | 3 mois | 6 mois | 3 ans | 5 ans |
|--|--------|--------|--------|-------|-------|
| Lyxor US Curve Flattening 2-10 UCITS ETF - Acc | -1,09% | -1,72% | -1,33% | -     | -     |
| Benchmark                                      | -1,05% | -1,59% | -1,06% | -     | -     |
| Ecart de Performance                           | -0,04% | -0,13% | -0,27% | -     | -     |

|  | YTD    | 2019   | - | - | - |
|--|--------|--------|---|---|---|
| Lyxor US Curve Flattening 2-10 UCITS ETF - Acc | 0,18%  | 2,00%  | - | - | - |
| Benchmark                                      | 0,64%  | 2,26%  | - | - | - |
| Ecart de Performance                           | -0,46% | -0,27% | - | - | - |
| Tracking Error                                 | -      | -      | - | - | - |

\* Depuis le lancement, 18/07/2019

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 30 octobre 2020

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. Ceci 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 |    |
|---|------------|----|----|
| Solactive USD Daily (x7) Flattener 2-10 Index | 18/07/2019 |    |    |
|   | 1Y         | 3Y | 5Y |
| Volatilité du Fonds                           | 4,35%      | -  | -  |
| Volatilité de l'indice                        | 4,35%      | -  | -  |
| Ratio de Sharpe                               | -0,21      | -  | -  |

## 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 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, 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(le).

---

## Notice pour l'investisseur

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 US Curve Flattening 2-10 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 US Curve Flattening 2-10 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.

Société Générale 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 (DIC). Le DIC en langue française, ainsi que le prospectus en langue anglaise, 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).

**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](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 (l'« Indice ») n'est ni parrainé, ni approuvé, ni vendu par Société Générale, Lyxor AM ou Lyxor Asset Management Luxembourg. Ni Société Générale, ni Lyxor AM ni Lyxor Asset Management Luxembourg 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 Lyxor Asset Management Luxembourg 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.**