

PERFORMANCE DEPUIS LE LANCEMENT



Les performances passées ne sauraient présager des performances futures.

PERFORMANCE DEPUIS LE LANCEMENT

	MTD	3 mois	6 mois	YTD	12 Derniers Mois	3 ans	Depuis le lancement
EuroGovies Risk Balanced - XI (EUR)	-0,08%	-0,14%	-0,26%	-0,26%	-0,18%	-0,76%	-1,55%
ESTR	-0,05%	-0,15%	-0,29%	-0,29%	-0,58%	-1,66%	-3,13%

Performances nettes de frais de gestion à partir des valeurs liquidatives officielles.

PERFORMANCES MENSUELLES

	janv.	févr.	mars	avr.	mai	juin	juil.	août	sept.	oct.	nov.	déc.	YTD
2022	-0,07%	-0,04%	0,00%	-0,01%	-0,05%	-0,08%							-0,26%
2021	-0,05%	-0,14%	0,07%	-0,01%	-0,06%	0,01%	0,13%	-0,09%	-0,01%	0,05%	0,01%	-0,02%	-0,11%
2020	0,07%	-0,01%	-0,48%	-0,16%	0,21%	0,13%	0,07%	-0,05%	0,10%	0,17%	0,01%	-0,03%	0,04%
2019	-0,12%	-0,05%	0,15%	0,02%	0,05%	-0,07%	-0,04%	-0,16%	-0,04%	-0,05%	-0,13%	-0,01%	-0,44%
2018	-0,27%	0,01%	0,02%	-0,07%	-0,04%	0,02%	-0,09%	-0,05%	-0,09%	-0,06%	-0,15%	-0,21%	-0,96%
2017	-0,41%	0,03%	-0,01%	0,43%	0,00%	-0,22%	0,04%	-0,02%	0,00%	0,04%	-0,04%	-0,12%	-0,28%
2016	-0,01%	0,07%	0,39%	-0,20%	0,15%	0,17%	0,08%	-0,11%	0,10%	-0,17%	-0,18%	0,15%	0,45%

Les performances passées ne sauraient présager des performances futures.

Performances nettes de frais de gestion à partir des valeurs liquidatives officielles.

PRINCIPALES LIGNES EN PORTEFEUILLE (% d'actif de la Poche)

DEXGRP 0 5/8 01/17/26	13,56%
KOMMUN 0 1/4 02/16/24	7,69%
EUB 0 12/09/22	6,62%
KOMMUN 0 09/08/22	6,41%
SFILFR 0.1 10/18/22	5,36%
DEXGRP 1 1/4 11/26/24	5,34%
FRANCE (GOVT OF) 1.1 25/07/2022	5,34%
DEXGRP 0 1/2 01/17/25	5,34%
DEXGRP 0 05/29/24	5,30%
CADES 2 1/2 10/25/22	4,84%

POINTS CLÉS

Actif Net du Fonds (M EUR) :	477,27
Valeur Liquidative (EUR) :	9 952,66
Performance MTD :	-0,08%
Performance YTD :	-0,26%
Performance depuis le lancement :	-1,55%
Volatilité annuelle (ex-ante)* :	0,11%
Rating moyen :	AA
Spread moyen vs EURIBOR 3M :	4,1
Time to maturity moyen :	2,03
Sensibilité moyenne aux taux d'intérêt** :	-0,00141%

Pourcentage d'instruments à taux variable ou asset-swappés : 100%

Performances nettes de frais de gestion à partir des valeurs liquidatives officielles.

*Lyxor Asset Management / Donnée Gestion

**Sensibilité de la performance par bp de taux

OBJECTIF D'INVESTISSEMENT

L'objectif d'investissement du Lyxor IF EuroGovies Risk Balanced consiste à générer une appréciation nette du capital sur une période de 3 à 5 ans. Le Fonds s'appuie sur une méthodologie d'allocation d'actifs fondée sur le risque et développée en interne pour investir activement dans un univers de titres de créance émis par des émetteurs de niveau 1, composé essentiellement d'obligations souveraines européennes. Les titres de créance dans lesquels le Fonds investit sont des actifs liquides de haute qualité (High Quality Liquid Assets, « HQLA ») éligibles au ratio de liquidité à court terme (Liquidity Coverage Ratio, « LCR »).

CARACTERISTIQUES DU FONDS

Structure Juridique :	SICAV
Date de Lancement du Fonds :	18 novembre 2014
Date de Lancement de la Classe :	27 janvier 2016
Devise du Fonds :	EUR
Devise de Référence :	EUR
Société de Gestion :	Lyxor Asset Management S.A.S.
Dépositaire :	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG

Codes du fonds :

ISIN : LU1324185781

Bloomberg : -

Information sur la transaction :

Souscription minimale initiale : 1 000 000 EUR

Souscription minimale ultérieure : 1 action

Frais d'entrée/sortie : Néant / Néant

Frais de Gestion : 0,15%

Frais de Performance : 10% de la performance annuelle au-delà de l'Eonia

Liquidité : Quotidienne

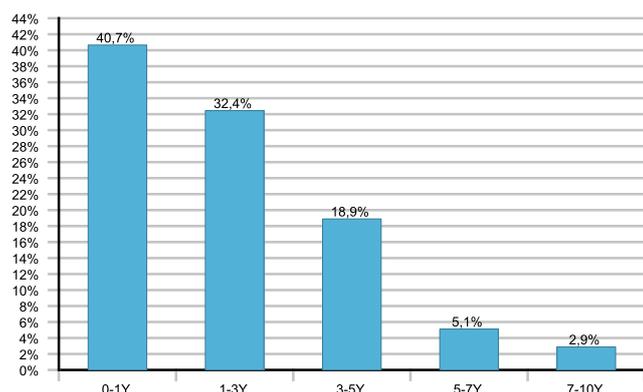
Date limite souscriptions/rachats : 11h00 (Heure du Luxembourg)

Règlement : J+2

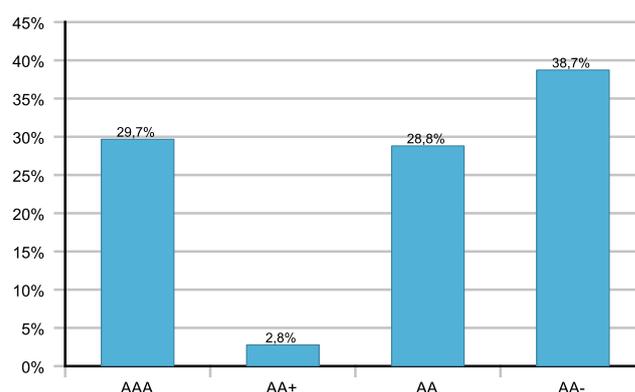
Les informations, données financières et recommandations contenues dans ce document ne sauraient constituer ni une offre d'achat, de vente ou de souscription d'instruments financiers, ni une offre de commercialisation, ni une offre de services financiers. Tout investisseur doit se référer aux termes et conditions du prospectus disponible sur simple demande. Ce Fonds peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays en vertu des réglementations nationales applicables à ces personnes ou dans ces pays. Il vous appartient donc de vous assurer que vous êtes autorisé à investir dans ce Fonds. Amundi Asset Management ("Amundi AM") et ses succursales déclinent toute responsabilité dans l'utilisation qui pourrait être faite de ces informations et des conséquences qui pourraient en découler. Les informations contenues dans le présent document sont communiquées à titre purement indicatif et n'ont aucune valeur contractuelle. Elles sont sujettes à des modifications, notamment en fonction des fluctuations de marché. Les données relatives aux performances passées ont trait ou se réfèrent à des périodes passées et ne sont pas un indicateur fiable des résultats futurs.

CLIENT SERVICES | +33 (0)142133131 | www.lyxor.com | client-services@lyxor.com

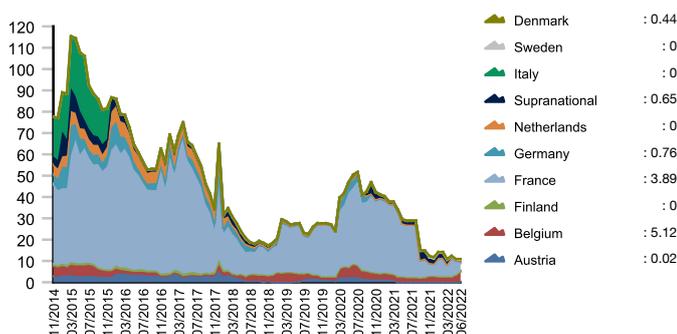
REPARTITION PAR MATURITE (% d'actif)



REPARTITION PAR RATING (% d'actif)



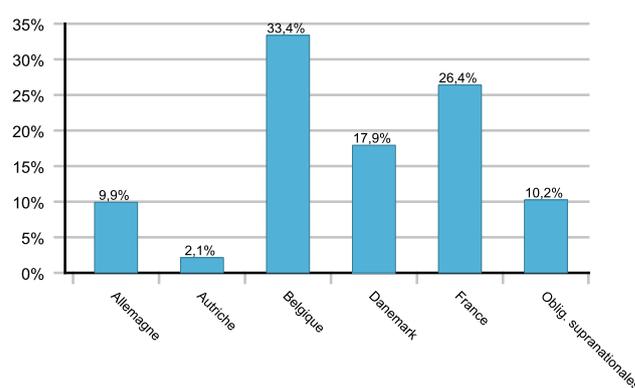
EVOLUTION DE LA CONTRIBUTION AU RISQUE CREDIT* DU PORTEFEUILLE**



*Mesure du risque crédit propriétaire Lyxor basée sur la volatilité des spreads de crédit des émetteurs

**Lyxor Asset Management / Donnée Gestion

REPARTITION GEOGRAPHIQUE DES EMETTEURS (% d'actif)



MENTIONS LEGALES

Ce document est exclusivement réservé aux investisseurs institutionnels agissant en leur propre compte et répondant à la définition de "contreparties éligibles" ou "clients professionnels" au sens de la Directive 2004/39/CE sur les marchés d'instruments financiers.

Ce document vous est fourni à titre d'information et n'est pas de nature réglementaire.

Le présent document ne constitue ni une offre, ni une incitation, ni un conseil ou une recommandation de la part de Lyxor Asset Management en vue de l'achat ou de la vente du produit mentionné ici.

Les informations ici reprises sont fournies à titre purement indicatif et n'ont aucune valeur contractuelle. Elles peuvent à tout moment faire l'objet de modifications, en particulier à la suite de fluctuations du marché.

Les éléments du présent document relatifs aux données de marchés sont fournis sur la base de données constatées à un moment précis et sont susceptibles de varier. L'exactitude, l'exhaustivité ou la pertinence des informations provenant de sources externes n'est pas garantie, bien qu'elle ait été obtenue auprès de sources jugées fiables.

Le présent document est confidentiel et ne peut être communiqué à aucun tiers (à l'exception de conseillers extérieurs sous réserve qu'ils respectent cet accord de confidentialité). Il ne peut pas être reproduit, en totalité ou en partie, sans accord écrit préalable de Lyxor Asset Management.

Lyxor Asset Management, société anonyme de droit français, est autorisée et réglementée en France par l'Autorité des Marchés Financiers en tant que société de gestion d'actifs depuis le 10 juin 1998 sous le numéro GP 98-19. Elle est immatriculée au Registre du Commerce et des Sociétés de Nanterre sous le numéro 418 862 215. Le siège social de Lyxor Asset Management est sis Tours Société Générale 17, cours Valmy - 92800 Puteaux - France.

INFORMATIONS IMPORTANTES POUR LES INVESTISSEURS**Aucune divulgation, reproduction ou utilisation extérieure autorisée :**

Ce document a été préparé uniquement pour les personnes à qui il a été distribué directement par Amundi AM ou l'un de ses affiliés ou délégués. Son contenu ne peut être divulgué, reproduit ou utilisé ou invoqué par toute autre personne, ou utilisé à toute autre fin.