

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 indiciaire, 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 US Treasury 1-3Y (DR) UCITS ETF - Dist est un ETF (exchange traded fund) conforme à la Directive UCITS. Il a pour objectif de répliquer l'indice Bloomberg Barclays U.S. Treasury: 1-3 Year Total Return Index. Cet indice reflète la performance des Bons du Trésor américain ayant des maturités comprises entre 1 et 3 ans, avec un encours d'au moins USD 300m.

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 DU SOUS-JACENT : L'indice sous-jacent d'un ETF Lyxor peut être complexe et volatile. 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.

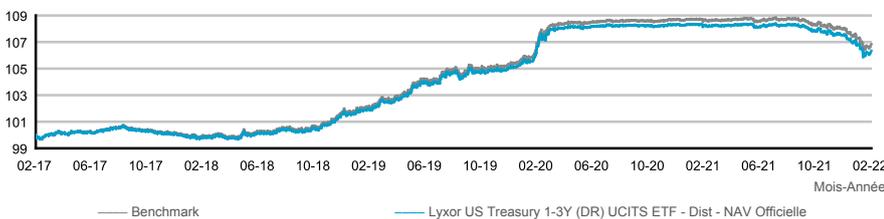
RISQUE DE LIQUIDITE : La liquidité est fournie par des teneurs de marché enregistrés sur les bourses où les ETF sont cotés. La liquidité sur les bourses peut être limitée du fait d'une suspension du marché sous-jacent représenté par l'indice sous-jacent suivi par l'ETF, d'une erreur des systèmes de l'une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

RISQUE MARCHES EMERGENTS: L'exposition de cet ETF à des marchés émergents entraîne un risque de perte plus important que celui applicable aux investissements effectués sur des marchés développés traditionnels. En particulier, les règles de fonctionnement et de supervision sur un marché émergent peuvent différer des standards applicables aux marchés développés.

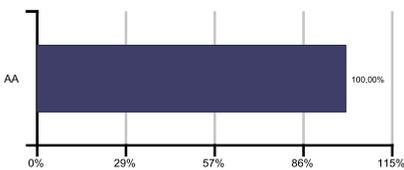
2. Information sur l'indice

Performance en base 100

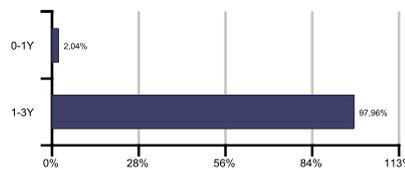
Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 28 février 2022



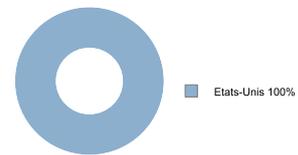
Répartition par rating



Répartition par maturité



Allocation géographique de l'indice



3. Performances ETF

	1 mois	3 mois	6 mois	3 ans	5 ans	10 ans
Lyxor US Treasury 1-3Y (DR) UCITS ETF - Dist	-0,42%	-1,34%	-1,83%	4,32%	6,34%	8,80%
Benchmark	-0,41%	-1,32%	-1,78%	4,61%	6,83%	10,08%
Ecart de Performance	-0,01%	-0,03%	-0,05%	-0,29%	-0,49%	-1,28%
	YTD					
Lyxor US Treasury 1-3Y (DR) UCITS ETF - Dist	-1,14%	-0,70%	3,08%	3,44%	1,47%	
Benchmark	-1,11%	-0,60%	3,16%	3,54%	1,57%	
Ecart de Performance	-0,02%	-0,10%	-0,08%	-0,10%	-0,11%	
Tracking Error	-	0,02%	0,03%	0,03%	0,02%	
	28/02/2022	26/02/2021	28/02/2020	28/02/2019	28/02/2018	28/02/2017
Lyxor US Treasury 1-3Y (DR) UCITS ETF - Dist	-1,77%	1,56%	4,57%	2,17%	-0,23%	
Benchmark	-1,68%	1,65%	4,66%	2,27%	-0,14%	
Ecart de Performance	-0,09%	-0,10%	-0,09%	-0,10%	-0,09%	

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 28 février 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. CECI VAUT ÉGALEMENT POUR LES DONNÉES DE MARCHÉ HISTORIQUES.

Ticker: US13 FP

Ticker	US13 FP
Enveloppe juridique	SICAV
UCITS	Oui
ISIN	LU1407887162
PEA	Non
Méthode de réplication	Directe (Physique)
Echantillonnage	Non
Prêt de titres	Non
Devise de Référence	USD
Date de Lancement	10/11/2010
VL de lancement (USD)	100
TFE (frais/an)	0,07%
Risque de change	Oui
Valeur Liquidative (USD)	99,25
Actif Net de la part (M USD)	156,91
Actif Net du Fonds (M USD)	174,69
Encours SICAV (M USD)	65 747,05
Investissement minimal (part)	1
Affectation des résultats	Distribution
Valeur du dernier détachement (USD)	0,48
Date en cas de distribution	Juillet et Décembre

Informations sur les cotations

Place	Horaires (GMT)	Devise	Code Bloomberg	RIC Reuters
SIX Swiss Exchange*	08:00 / 16:20	USD	LYUS13 SW	LYUS13.S
NYSE Euronext Paris	08:00 / 16:30	EUR	US13 FP	US13.PA
Borsa Italiana (Milano)	08:00 / 16:30	EUR	US13 IM	US13.MI
LSE	08:00 / 16:30	USD	US13 LN	US13.L
LSE	08:00 / 16:30	GBP	U13G LN	U13G.L

* Première place de cotation pour cette classe de parts

Nom	Bloomberg Barclays U.S. Treasury: 1-3 Year Total Return Index
Exposition	USA
Classe d'actifs	Obligations
Type	Total Return
Devise	USD
RIC Reuters	-
Code Bloomberg de l'indice	LT01TRUU
Informations complémentaires	-
Taux du coupon (%)	1,28
Yield (%)	1,44
Duration (Années)	1,96
Duration modifiée (Années)	1,95
Maturité (Années)	1,99
Convexité (%)	0,05

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 28 février 2022

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
iBoxx USD Treasuries 1-3Y Total Return Index	10/11/2010	07/09/2015
Markit iBoxx USD Treasuries 1-3 Mid Price	07/09/2015	17/12/2019
TCA TRI		
Bloomberg Barclays U.S. Treasury: 1-3 Year Total Return Index	17/12/2019	

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

**Jusqu'au 13/10/2016, l'historique des performances du fonds Lyxor iBoxx USD Treasuries 1-3Y (DR) UCITS ETF correspond aux performances de LYXOR UCITS ETF IBOXX \$ TREASURIES 1-3Y (DR). Ce fonds a été absorbé par Lyxor iBoxx USD Treasuries 1-3Y (DR) UCITS ETF le 13/10/2016.

Depuis le lancement

Ratio de Sharpe	0,22			
	1Y	3Y	5Y	10Y
Volatilité du Fonds	0,98%	1,04%	0,95%	0,85%
Volatilité de l'indice	0,97%	1,04%	0,95%	0,85%
Ratio de Sharpe	-1,92	0,59	0,08	0,16
Tracking Error	0,08%	0,11%	0,11%	0,11%

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 US Treasury 1-3Y (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 US Treasury 1-3Y (DR) 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 (DICI). Le DICI 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](mailto: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.