

## Lyxor S&P 500 UCITS ETF - Dist (USD)

### 1. INFORMAZIONI SUL FONDO

#### Obiettivo di gestione di questo ETF

Il Lyxor S&P 500 UCITS ETF - Dist (USD) è un exchange-traded fund conforme alla direttiva UCITS che punta a replicare l'indice di riferimento S&P 500 Net Total Return Index.

L'indice S&P 500 Net Total Return Index include le 500 società leader operanti nei settori di punta dell'economia americana e riflette su base continua le caratteristiche in termini di rischio e rendimento di ampio ventaglio di large-cap. La metodologia di calcolo completa dell'indice è disponibile su: [www.standardandpoors.com](http://www.standardandpoors.com)

Gli ETF di Lyxor costituiscono efficaci veicoli d'investimento quotati in borsa che offrono un'esposizione trasparente, liquida e a basso costo all'indice di riferimento sottostante.

#### Informazioni sulle negoziazioni

Borsa di Quotazione	Orario d'apertura (GMT)	Valuta	Ticker Bloomberg	RIC Reuters	Distribuzione	Fx Hedge
SIX Swiss Exchange	08:00 / 16:20	USD	LYSP5 SW	LYSP5.S	SI	No
LSE*	08:00 / 16:30	USD	LSPU LN	LSPU.L	SI	No
LSE	08:00 / 16:30	GBP	LSPX LN	LSPX.L	SI	No
Deutsche Boerse (Xetra)	08:00 / 19:00	EUR	6TVM GY	6TVM.DE	SI	No
NYSE Euronext Paris**	08:00 / 16:30	EUR	SP5C FP	SP5C.PA	No	No
LSE**	08:00 / 16:30	USD	SP5C LN	SP5C.L	No	No
LSE**	08:00 / 16:30	GBP	SP5L LN	SP5L.L	No	No
Bolsa Mexicana de Valores**	14:00 / 21:00	MXN	SP5CN MM	SP5CN.MX	No	No
SIX Swiss Exchange**	08:00 / 16:20	CHF	LYSPH SW	LYSPH.S	SI	SI
NYSE Euronext Paris**	08:00 / 16:30	EUR	SP5H FP	SP5H.PA	SI	SI
Borsa Italiana (Milano)**	08:00 / 16:30	EUR	SPXH IM	SPXH.MI	SI	SI
Deutsche Boerse (Xetra)**	08:00 / 19:00	EUR	LYP2 GY	LYP2.DE	SI	SI
LSE**	08:00 / 16:30	GBP	SP5G LN	SP5G.L	SI	SI
Deutsche Boerse (Xetra)**	08:00 / 19:00	EUR	LYPS GY	LYXSP.DE	SI	No
Borsa Italiana (Milano)**	08:00 / 16:30	EUR	SPX IM	LYXSP.MI	SI	No
NYSE Euronext Paris**	08:00 / 16:30	EUR	SP5 FP	SP5.MC	SI	No
Bolsa de Madrid**	08:00 / 16:30	EUR	SP5 SM	LYXSP.MI	SI	No
Warsaw Stock Exchange**	08:00 / 16:00	PLN	LYPS PW	ETFSP500.WA	SI	No

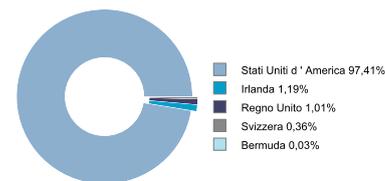
\* Prima piazza di quotazione di questa classe di quote \*\* Quotazione di altre classi di quote

### 2. Informazioni sull'indice

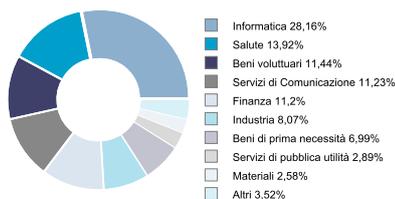
Fonte: Bloomberg, Lyxor AM, a 4 settembre 2020



#### Allocazione geografica dell'indice



#### Allocazione settoriale dell'indice



### 3. Performance dell' ETF

	1 mese	3 mesi	6 mesi	3 anni	5 anni
Lyxor S&P 500 UCITS ETF - Dist (USD)	3.83%	10.58%	10.53%	46.24%	96.07%
Benchmark	3.79%	10.44%	10.24%	44.20%	91.52%
Differenziale di performance	0.05%	0.14%	0.29%	2.04%	4.56%

	Da inizio	2019	2018	2017	2016
Lyxor S&P 500 UCITS ETF - Dist (USD)	7.44%	31.31%	-4.55%	21.69%	11.79%
Benchmark	7.05%	30.70%	-4.94%	21.10%	11.23%
Differenziale di performance	0.38%	0.62%	0.40%	0.59%	0.57%
Tracking Error	-	0.01%	0.01%	0.01%	0.01%

Fonte: Bloomberg, Lyxor AM, a 4 settembre 2020

I dati relativi a performance passate / performance passate simulate / performance passate e performance passate simulate si riferiscono o sono connessi a periodi passati e non sono indicativi di risultati futuri. Ciò vale anche per i dati di mercato storici.

Ticker: LYSP5 SW

#### Carat. princip. del Fondo

Ticker	LYSP5 SW
Forma legale	SICAV
Domiciliazione	Lussemburgo
UCITS	SI
ISIN	LU0496786657
Tassa Svizzera	SI
Metodologia di Replica	Indiretta (swap based)
Prestito titoli	No
Proprietà piena del patrim.	SI
Valuta della classe dell'ETF	USD
Data di istituzione	26/03/2010
NAV alla data di istituzione (USD)	11.67
Commissioni Totali Annuie (TER)	0,15%
Rischio di cambio	No
NAV di 1 ETF (USD)	35.02
Patrimonio della Classe (M USD)	3'514.68
Patrimonio Fondo/Sicav (M USD)	10'279.96
Patrimonio Sicav ombrello (M USD)	42'504.44
Investimento minimo (Quota)	1
Dividendi	Distribuzione
Valore dell'ultimo dividendo (USD)	0.33
Data distribuzione dividendi	Luglio e Dicembre

Fonte: Lyxor AM, 4 settembre 2020

Nome intero	S&P 500 Net Total Return Index
Esposizione	USA
Classe di attivo	Azioni
Tipologia dell'Indice	Net Total Return
Valuta	USD
RIC Reuters Indice	.SPXNTR
Ticker Bloomberg Indice	SPTR500N
Informazioni aggiuntive	<a href="http://www.indices.standardandpoors.com">www.indices.standardandpoors.com</a>

#### Primi dieci componenti

Apple Inc	6.89%
Microsoft Corp	5.77%
Amazon.Com Inc	4.94%
Facebook Inc-Class A	2.45%
Alphabet Inc-CI A	1.71%
Alphabet Inc-CI C	1.68%
Berkshire Hathaway Inc-CI B	1.48%
Johnson & Johnson	1.38%
Visa Inc-Class A Shares	1.23%
Procter & Gamble Co/The	1.20%

Le performance relative agli ETF a distribuzione sono calcolate reinvestendo i dividendi nella performance dell'ETF. Il Gap di performance rappresenta le differenze di rendimento tra l'ETF e l'Indice. Il Tracking error rappresenta la volatilità annualizzata delle differenze di performance tra l'ETF e il benchmark.

Possono verificarsi variazioni del benchmark. Per comparare l'andamento dell'ETF rispetto al suo benchmark, utilizziamo gli indici indicati di seguito:

	Da	A
S&P 500 Index	26/03/2010	06/04/2011
S&P 500 Net Total Return Index	06/04/2011	

	1Y	3Y	5Y
Volatilità del Fondo	29.56%	21.02%	17.72%
Volatilità del Benchmark	29.56%	21.02%	17.72%
Indice di Sharpe	0.61	0.56	0.74

## Fattori di rischio

I potenziali investitori devono valutare i rischi descritti di seguito e nel prospetto informativo del fondo, disponibile sul sito [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com)

**CAPITALE A RISCHIO:** Gli ETF sono strumenti di replica: il loro profilo di rischio è simile a quello di un investimento diretto nell'Indice sottostante. Il capitale è interamente a rischio e gli investitori potrebbero non recuperare l'importo inizialmente investito.

**RISCHIO DI REPLICA:** Gli obiettivi del fondo potrebbero non essere conseguiti a causa di eventi imprevisibili nei mercati sottostanti, i quali inciderebbero sul calcolo dell'Indice e sull'efficienza della replica del fondo.

**RISCHIO DI CONTROPARTE:** Gli investitori sono esposti ai rischi derivanti dall'utilizzo di uno swap OTC con Societe Generale. Conformemente alle linee guida sugli OICVM, l'esposizione a Societe Generale non può superare il 10% del patrimonio complessivo del fondo.

**RISCHIO SOTTOSTANTE:** L'Indice sottostante di un ETF Lyxor può essere complesso e volatile. Se si investe in materie prime, l'Indice sottostante è calcolato in riferimento ai contratti futures su materie prime che espongono l'investitore a un rischio di liquidità legato a costi come quelli di trasporto. Gli ETF con un'esposizione ai Mercati emergenti presentano un rischio di potenziali perdite più elevato rispetto a un investimento nei Mercati sviluppati, poiché essi sono soggetti a un'ampia gamma di rischi imprevedibili nei Mercati emergenti.

**RISCHIO DI CAMBIO:** Un ETF potrebbe essere esposto al rischio di cambio qualora sia denominato in una valuta diversa da quella dell'Indice sottostante che sta replicando. Ciò significa che le fluttuazioni dei tassi di cambio potrebbero avere sul rendimento un effetto negativo così come positivo.

**RISCHIO DI LIQUIDITÀ:** La liquidità è fornita da operatori di mercato autorizzati della borsa valori sulla quale è quotato l'ETF, tra cui Societe Generale. La liquidità sulla borsa può essere limitata a causa di una sospensione nel mercato sottostante rappresentato dall'Indice sottostante replicato dall'ETF; di un guasto nei sistemi di una borsa valori, di Societe Generale o di altri operatori di mercato; oppure di una situazione o evento anomalo in fase di contrattazione.

## Avvertenze

Il presente documento è stato redatto da Lyxor Asset Management. Esso, unitamente alle informazioni che vi figurano, non costituisce né un prospetto d'emissione ai sensi degli articoli 652a del Codice delle obbligazioni svizzero (CO) né un prospetto di quotazione ai sensi del Regolamento di quotazione della SIX Swiss Exchange. Le informazioni contenute nel presente documento sono fornite a titolo indicativo e hanno scopo meramente informativo. Societe Generale e Lyxor International Asset Management S.A.S. non si assumono alcuna responsabilità in merito all'esattezza, all'eshaustività o all'aggiornamento delle informazioni tratte da fonti esterne, sebbene queste ultime siano ritenute attendibili.

Il presente documento non costituisce né un'offerta né un invito a investire o ad acquisire qualsivoglia strumento finanziario. Societe Generale, Lyxor AM e Lyxor Asset Management Luxembourg declinano ogni responsabilità in merito alle eventuali conseguenze finanziarie che potrebbero derivare dalla sottoscrizione o dall'acquisto di uno qualsiasi degli strumenti finanziari descritti nel presente documento.

Compete all'investitore valutare autonomamente i rischi e consultare, se necessario, il proprio consulente legale, finanziario, fiscale o contabile, o qualsiasi altro consulente professionista, prima di ogni sottoscrizione o acquisto.

Il presente documento non può essere copiato, riprodotto o distribuito, in toto o in parte, senza il consenso preventivo di Societe Generale, Lyxor AM e Lyxor Asset Management Luxembourg. I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri.

Gli investimenti in ETF Lyxor possono essere oggetto di limitazioni in relazione a talune persone o in alcuni paesi, in virtù di regolamentazioni nazionali applicabili a tali persone o in tali paesi. È responsabilità dell'investitore determinare se è o meno autorizzato a investire in questi prodotti.

Investendo in questi prodotti, l'investitore conferma a Societe Generale di essere debitamente autorizzato a farlo, consultando, ove lo reputi necessario, il proprio consulente d'investimento o qualsiasi altro professionista competente.

Gli ETF Lyxor sono offerti esclusivamente al di fuori degli Stati Uniti e conformemente alla Regulation S della Legge statunitense sui valori mobiliari del 1933 (la "Regulation S"). Gli ETF Lyxor possono essere venduti o offerti nuovamente solo a "non US Persons" nell'ambito di "Offshore Transactions" conformemente alle disposizioni applicabili in materia di rivendita previste dalla Regulation S.

Il paese di origine dell'organismo d'investimento collettivo del risparmio è Lussemburgo. L'organismo di investimento collettivo del risparmio Lyxor S&P 500 UCITS ETF è quotato alla SIX Swiss Exchange e/o BX Swiss Exchange e autorizzato alla distribuzione in Svizzera o a partire dalla Svizzera, conformemente all'articolo 120 della Legge federale sugli investimenti collettivi di capitale del 23 giugno 2006.

In riferimento alle azioni distribuite in Svizzera, il luogo di esecuzione e giurisdizione è stabilito presso la sede legale del Rappresentante in Svizzera.

L'Autorità di vigilanza sui mercati finanziari (FINMA) ha autorizzato Societe Generale, Paris, filiale di Zurigo, a esercitare la funzione di rappresentante e agente pagatore per questi prodotti in Svizzera.

Il prospetto informativo, il prospetto semplificato, il documento contenente le informazioni chiave per gli investitori (KIID), lo statuto, il regolamento di gestione, le relazioni annuali e semestrali nonché qualsiasi altro documento ai sensi dell'art. 133 dell'Ordinanza sugli investimenti collettivi di capitale (OICo) possono essere ottenuti gratuitamente presso il rappresentante in Svizzera:

SOCIETE GENERALE PARIS, Zurich Branch, Lyxor ETF Team Switzerland, Talacker 50, P.O. Box 1928, CH-8021 Zurich, [www.lyxoretf.ch](http://www.lyxoretf.ch), [info@lyxoretf.ch](mailto:info@lyxoretf.ch), +41 58 272 33 44