# Lyxor Core iBoxx $ Treasuries 3-5Y (DR) UCITS ETF - Dist

Ticker: U35G LN

## 1. INFORMAZIONI SUL FONDO

### Obiettivo di gestione di questo ETF

Il Lyxor Core iBoxx $ Treasuries 3-5Y (DR) UCITS ETF - Dist è un exchange-traded fund conforme alla direttiva UCITS che punta a replicare l'indice di riferimento Markit iBoxx USD Treasuries 3-5 Mid Price TCA TRI. L'indice Markit iBoxx USD Treasuries 3-5 Mid Price TCA TRI fornisce un'esposizione ai titoli di stato statunitensi che hanno una scadenza tra 3 e 5 anni. L'indice fa parte della famiglia di indici Markit iBoxx USD che rappresenta il più grande segmento del mercato fixed income per le obbligazioni denominate in dollari. è compilato, amministrato e gestito da Markit, un index provider. L'intera metodologia e maggiori dettagli sono disponibili sulla sezione Indici del sito internet www.markit.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+1) | Valuta | Ticker Bloomberg | RIC Reuters | Distribuzione |
|---|---|---|---|---|---|
| LSE* | 09:00 / 17:30 | GBP | U35G LN | .U35G | Sì |
| LSE | 09:00 / 17:30 | USD | US35 LN | US35.L | Sì |
| BERNE STOCK EXCHANGE | 09:00 / 17:30 | CHF | U35G BW | U35G.BN | Sì |

* Prima piazza di quotazione di questa classe di quote

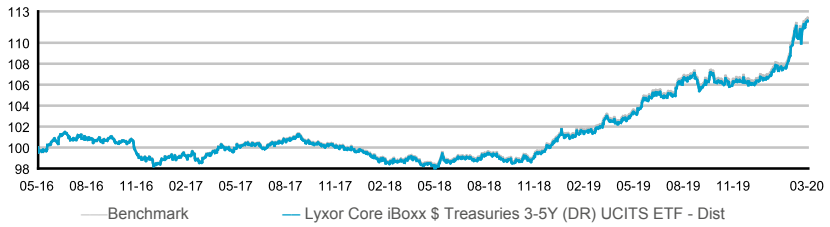
### Carat. princip. del Fondo

| | |
|---|---|
| Ticker | U35G LN |
| Forma legale | SICAV |
| Domiciliazione | Lussemburgo |
| UCITS | Sì |
| ISIN | LU1407889887 |
| Metodologia di Replica | Diretta (Fisica) |
| Campion. | No |
| Prestito titoli | No |
| Valuta della classe dell'ETF | USD |
| Data di istituzione | 17/05/2016 |
| NAV alla data di istituzione (USD) | 100 |
| Data di prima quotazione | 27/06/2016 |
| Commissioni Totali Annue (TER) | 0,07% |
| Rischio di cambio | Sì |
| NAV di 1 ETF (USD) | 103,92 |
| Patrimonio della Classe (M USD ) | 9,66 |
| Patrimonio Fondo/Sicav (M USD) | 9,66 |
| Patrimonio Sicav ombrello ( M USD ) | 32.985,81 |
| Investimento minimo (Quota) | 1 |
| Dividendi | Distribuzione |
| Data distribuzione dividendi | Luglio e Dicembre |
| Valore dell'ultimo dividendo (USD) | 0,88 |

Fonte: Lyxor AM, 31 marzo 2020

## 2. Informazioni sull'indice

Fonte: Bloomberg, Lyxor AM, a 31 marzo 2020




### Primi dieci componenti

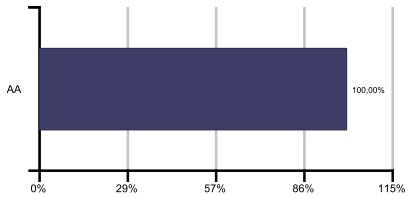
| | | | |
|---|---|---|---|
| T 2 1/8 03/31/24 | 3,31% | T 2 1/4 11/15/24 | 3,05% |
| T 2 05/31/24 | 3,29% | T 2 3/8 08/15/24 | 3,04% |
| T 2 3/4 11/15/23 | 3,07% | T 2 1/2 08/15/23 | 3,01% |
| T 2 1/2 05/15/24 | 3,06% | T 2 02/15/25 | 3,00% |
| T 2 3/4 02/15/24 | 3,06% | T 1 3/4 05/15/23 | 2,95% |

Numero di componenti dell'indice 57

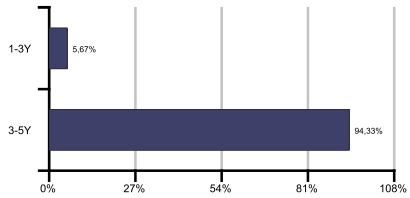
Fonte: Bloomberg, Lyxor AM, a 31 marzo 2020

| | |
|---|---|
| Nome intero | Markit iBoxx USD Treasuries 3-5 Mid Price TCA TRI |
| Esposizione | USA |
| Classe di attivo | Obbligazioni |
| Tipologia dell'Indice | Gross Total Return |
| Valuta | USD |
| RIC Reuters Indice | - |
| Ticker Bloomberg Indice | IBXXABXP |
| Informazioni aggiuntive | - |
| Cedola Media (%) | 2,24 |
| Rendimento(%) | 0,33 |
| Duration | 3,77 |
| Duration Modificata | 3,75 |
| Scadenza (anni) | 3,92 |
| Convexity (%) | 18,52 |

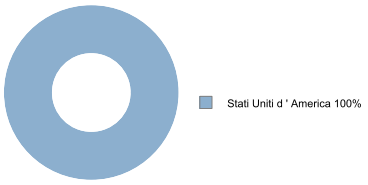
### Ripartizione per Rating




### Ripartizione per Scadenza




### Allocazione geografica dell'indice




## 3. Performance dell' ETF

| | 1 mese | 3 mesi | 6 mesi | 3 anni | 5 anni |
|---|---|---|---|---|---|
| **Lyxor Core iBoxx $ Treasuries 3-5Y (DR) UCITS ETF - Dist** | **2,26%** | **5,40%** | **5,45%** | **12,72%** | - |
| Benchmark | 2,27% | 5,42% | 5,48% | 12,96% | - |
| Differenziale di performance | -0,02% | -0,02% | -0,03% | -0,23% | - |

| | Da inizio anno | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 * |
|---|---|---|---|---|---|
| **Lyxor Core iBoxx $ Treasuries 3-5Y (DR) UCITS ETF - Dist** | **5,40%** | **5,07%** | **1,40%** | **0,90%** | **-1,09%** |
| Benchmark | 5,42% | 5,14% | 1,47% | 0,97% | -1,07% |
| Differenziale di performance | -0,02% | -0,07% | -0,08% | -0,07% | -0,02% |
| Tracking Error | - | 0,02% | 0,02% | 0,03% | 0,00% |

Fonte: Bloomberg, Lyxor AM, a 31 marzo 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.**

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 perfomance 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 |
|---|---|---|
| Markit iBoxx USD Treasuries 3-5 Mid Price TCA TRI | 17/05/2016 | |

| | 1Y | 3Y | 5Y |
|---|---|---|---|
| Volatilità del Fondo | 3,02% | 2,42% | - |
| Volatilità del Benchmark | 3,02% | 2,42% | - |
| Indice di Sharpe | 2,27 | 0,96 | - |

Per Informazioni
800 92 93 00 | info@etf.it | www.lyxoretf.it

LYXOR etf
SOCIETE GENERALE GROUP

## 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
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 imprevisti nei mercati sottostanti, i quali inciderebbero sul calcolo dell'indice e sull'efficiente replica del fondo.
RISCHIO SOTTOSTANTE: L'Indice sottostante di un ETF Lyxor pu 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. Ci significa che le fluttuazioni dei tassi di cambio potrebbero avere sul rendimento un effetto negativo cos 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 Société Générale. La liquidità sulla borsa pu 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 Société Générale o di altri operatori di mercato; oppure di una situazione o evento anomalo in fase di contrattazione.

## Avvertenze

* L' ETF qui menzionato è un OICR gestito da Lyxor International Asset Management SA (qui per brevità "Lyxor"). Il relativo prospetto è approvato dalla AMF, in caso di ETF con codice Isin che inizia per FR, o dalla CSSF, in caso di ETF con codice Isin che inizia per LU).

Avvertenza 1: I risultati passati non sono indicativi di quelli futuri . I rendimenti possono essere ridotti da commissioni , tasse o altri oneri a carico dell'investitore.

Il presente documento, predisposto da Société Générale, ha finalità di carattere meramente informativo. Le opinioni, i commenti e i giudizi ivi contenuti hanno solamente natura informativa. Nulla di quanto contenuto in questo documento deve intendersi come sollecitazione o offerta, consulenza in materia di investimenti, legale, fiscale o di altra natura o raccomandazione ad intraprendere qualsiasi investimento negli strumenti finanziari in oggetto. Il presente documento non è da considerarsi esaustivo e ha solo scopi informativi.
Societe Generale e Lyxor International Asset Management S.A.S. non sono responsabili per eventuali danni, derivanti anche da imprecisioni e/o errori, che possano derivare all'investitore e/o a terzi dall'uso dei dati e delle informazioni contenuti nel presente documento. Le informazioni contenute nel presente documento possono provenire da fonti terze e, nonostante queste siano state utilizzate in quanto ritenute affidabili, Societe Generale, Lyxor AM e Lyxor Asset Management Luxembourg non assumono alcuna responsabilità sulla loro correttezza e completezza.
Il sottoscrittore non dovrà basare la propria decisione di investire nel prodotto sulle informazioni fornitegli nel presente documento bensì dovrà analizzare autonomamente i vantaggi ed i rischi del prodotto sotto gli aspetti legale, fiscale e contabile rivolgendosi, se lo riterrà opportuno, ai propri consulenti specializzati o ad altri professionisti competenti. Societe Generale, Lyxor AM e Lyxor Asset Management Luxembourgnon potranno essere ritenute responsabili delle conseguenze finanziarie o di altra natura derivanti dall'investimento nei prodotti elencati.
La vendita del prodotto ad alcuni soggetti o in alcuni paesi potrebbe essere subordinata a restrizioni normative. Il valore dell'ETF può aumentare o diminuire nel corso del tempo. Si evidenzia che gli ETF rientrano nell'ambito delle disposizioni CONSOB inerenti allo short selling di volta in volta applicabili.
Il valore dell'ETF può aumentare o diminuire nel corso del tempo. Relativamente agli ETF che incorporano un effetto leva, il valore dell'ETF amplierà le oscillazioni al rialzo e/o al ribasso rispetto all'indice di riferimento, nel caso in cui questo non incorpori tale effetto leva. In ogni caso, si consideri che l'ETF potrebbe perdere in misura anche significativa il suo valore.
Le commissioni indicate non considerano l'ammontare dell'imposta applicabile ai sensi del vigente regime fiscale e/o l'importo di eventuali commissioni, competenze o altri oneri a carico dell'investitore applicate dal proprio intermediario. L'applicazione del trattamento fiscale dipende dallo specifico status fiscale di ciascun investitore, nonché dalle leggi di volta in volta applicabili in materia. Si consideri, inoltre, che il trattamento fiscale potrà essere modificato in qualsiasi momento. Per ulteriori informazioni, si consiglia di chiedere assistenza al proprio consulente fiscale di fiducia.
I gestori degli indici di riferimento dei citati ETF non sponsorizzano, promuovono, distribuiscono o supportano gli ETF e non danno alcuna garanzia sul valore dell'indice e sui risultati derivanti dal suo uso e non sono responsabili di errori nell'indice.
**Prima dell'investimento negli ETF qui menzionati leggere attentamente il Prospetto Completo, il KIID ed il Documento di Quotazione** disponibili sul sito www.ETF.it e presso Société Générale, Listed Products, via Olona 2, 20123 Milano, ove sono illustrati in dettaglio i relativi meccanismi di funzionamento, i fattori di rischio e i costi.