

Lyxor Euro Government Bond 5-7Y (DR) UCITS ETF - Acc

1. INFORMATIONS SUR LE FONDS

Objectif d'investissement

Le Lyxor Euro Government Bond 5-7Y (DR) UCITS ETF - Acc est un ETF (exchange traded fund) conforme à la Directive UCITS. Il a pour objectif de répliquer l'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 5-7 Year Bond Index. Cet indice reflète la performance d'obligations gouvernementales libellées en euros émises par des pays de l'Union économique et monétaire avec un minimum de €50 milliards d'émissions. Les titres éligibles doivent avoir des maturités comprises entre 5 et 7 ans, avec un encours d'au moins €300m.

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	MTC FP	LMTC.PA	Non
Borsa Italiana (Milano)*	08:00 / 16:30	EUR	EM57 IM	EM57.MI	Non
SIX Swiss Exchange	08:00 / 16:20	EUR	LYMTC SW	LYMTC.S	Non
XETRA	08:00 / 16:30	EUR	LYXC GW	LYXC.DE	Non
BERNE STOCK EXCHANGE	08:00 / 16:30	EUR	LYMTC BW	LYMTC.BN	Non
Deutsche Boerse (Xetra)**	08:00 / 19:00	EUR	EGV7 GY	EGV7.DE	Oui

* Première place de cotation pour cette classe de parts ** Cotation des autres classes de parts

2. Information sur l'indice

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 18 septembre 2020

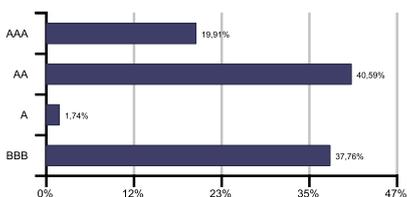


Dix principales valeurs

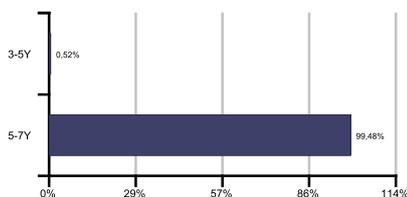
Frtr 3 1/2 04/25/26	5,40%	Frtr 0 1/2 05/25/26	3,70%
Frtr 6 10/25/25	4,21%	Dbr 0 1/2 02/15/26	3,21%
Frtr 1 05/25/27	3,92%	Dbr 0 1/4 02/15/27	3,18%
Frtr 0 1/4 11/25/26	3,79%	Spgb 5.9 07/30/26	3,14%
Frtr 1 11/25/25	3,78%	Dbr 0 1/2 08/15/27	3,13%

Nombre de composants 48

Répartition par rating



Répartition par maturité



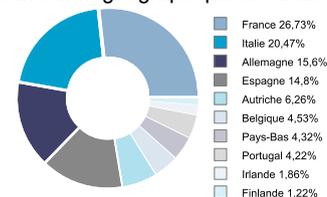
Caractéristiques Principales du Fonds

Ticker	MTC FP
Enveloppe juridique	SICAV
Domiciliation	Luxembourg
UCITS	Oui
ISIN	LU1287023003
PEA	Non
Méthode de réplcation	Directe (Physique)
Echantillonnage	Non
Prêt de titres	Non
Devise de Référence	EUR
Date de Lancement	18/01/2007
VL de lancement (EUR)	162,139
TFE (frais/an)	0,165%
Risque de change	Non
Valeur Liquidative (EUR)	169,94
Actif Net de la part (M EUR)	219,53
Actif Net du Fonds (M EUR)	228,75
Encours SICAV (M EUR)	36 285,91
Investissement minimal (part)	1
Affectation des résultats	Capitalisation

Source: Lyxor AM, 18 septembre 2020

Nom	Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 5-7 Year Bond Index
Exposition	Eurozone
Classe d'actifs	Obligations
Type	Total Return
Devise	EUR
RIC Reuters	-
Code Bloomberg de l'indice	I35208EU
Informations complémentaires	-
Taux du coupon (%)	1,85
Yield (%)	-0,27
Duration (Années)	5,66
Duration modifiée (Années)	5,68
Maturité (Années)	5,94
Convexité (%)	0,39

Allocation géographique de l'indice



3. Performances ETF

	1 mois	3 mois	6 mois	3 ans	5 ans
Lyxor Euro Government Bond 5-7Y (DR) UCITS ETF - Acc	0,19%	1,10%	4,45%	5,98%	9,12%
Benchmark	0,20%	1,15%	4,56%	6,55%	10,06%
Ecart de Performance	-0,01%	-0,05%	-0,10%	-0,58%	-0,94%

	YTD	2019	2018	2017	2016
Lyxor Euro Government Bond 5-7Y (DR) UCITS ETF - Acc	1,72%	3,99%	-0,02%	0,17%	1,91%
Benchmark	1,86%	4,18%	0,15%	0,31%	2,08%
Ecart de Performance	-0,14%	-0,19%	-0,17%	-0,14%	-0,18%
Tracking Error	-	0,04%	0,02%	0,01%	0,01%

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 18 septembre 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
EuroMTS 5-7Y	18/01/2007	06/06/2011
EuroMTS Ex CNO Etrix Index 1730 CET 5-7 year	06/06/2011	15/02/2012
EuroMTS Inv Grade Eurozone Government Bond 5-7yr 1730	15/02/2012	13/11/2014
MTS Mid Price InvG Ex-CNO Etrix 5-7 (EUR)	13/11/2014	12/12/2019
Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 5-7 Year Bond Index	12/12/2019	

*Jusqu'au 21/07/2016, l'historique des performances du fonds Lyxor EUROMTS 5-7Y Investment Grade (DR) UCITS ETF correspond aux performances de LYXOR UCITS ETF EUROMTS 5-7Y INVESTMENT GRADE (DR). Ce fonds a été absorbé par Lyxor EUROMTS 5-7Y Investment Grade (DR) UCITS ETF le 21/07/2016.

	1Y	3Y	5Y
Volatilité du Fonds	-	-	-
Volatilité de l'indice	-	-	-
Ratio de Sharpe	-	-	-

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 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 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 réplcient. 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 Euro Government Bond 5-7Y (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 Euro Government Bond 5-7Y (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.

Société Générale and 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.

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 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.