

1. INFORMATIONS SUR LE FONDS

Objectif d'investissement

Le Lyxor \$ Floating Rate Note UCITS ETF - Monthly Hedged to EUR - Dist est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence Bloomberg Barclays MSCI USD Corporate Liquid FRN 0-5 Year SRI Sustainable Index. Cet indice reflète la performance d'obligations à taux variable de qualité investment grade, libellées en dollar (USD) et émises par des entreprises (américaines ou autres), avec des maturités allant de 1 mois à moins de 5 ans. Les obligations qui composent cet indice ont un coupon variable, qui s'ajuste en fonction des mouvements du 3m USD LIBOR. L'indice exclut les émetteurs avec une notation MSCI ESG inférieure à BBB, les émetteurs impliqués dans certaines activités controversées (armes, alcool, tabac), et les émetteurs ayant un score MSCI « red flag » de controverse ESG. La part couverte en EUR est dotée d'un mécanisme de couverture de change mensuel simple intégré au produit d'investissement, une solution de gestion du risque de change efficace pour les investisseurs en EUR. Pour plus d'informations concernant cet indice, veuillez consulter : www.bloomberg.com

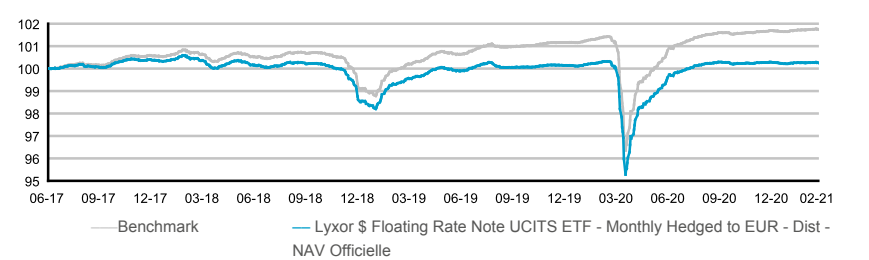
Informations sur les cotations

Place	Horaires (GMT)	Devise	Code Bloomberg	RIC Reuters	Distribution	Fx Hedge
Borsa Italiana (Milano)*	08:00 / 16:30	EUR	FLOTH IM	FLOTH.MI	Oui	Oui
LSE**	08:00 / 16:30	USD	BUOY LN	BUOY.L	Oui	Non
LSE**	08:00 / 16:30	GBP	SWIM LN	SWIM.L	Oui	Non
SIX Swiss Exchange**	08:00 / 16:20	CHF	BUOY SW	BUOY.S	Oui	Non

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

2. Information sur l'indice

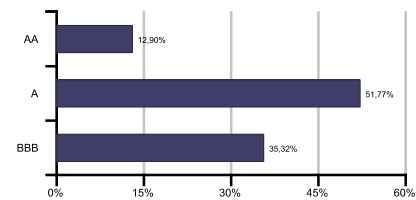
Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 26 février 2021



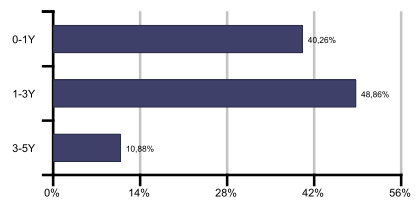
Dix principales valeurs

Ms 0 10/24/23	1,73%	Gs 0 02/23/23	1,32%
Jpm 0 10/24/23	1,50%	Mufg 0 07/26/23	1,24%
Hsbc 0 05/18/24	1,50%	Ms 0 05/08/24	1,22%
Ms 0 07/22/22	1,37%	Bacr 0 05/16/24	1,13%
Vz 0 05/15/25	1,36%	Rbs 0 05/15/23	1,13%
Nombre de composants	173		

Répartition par rating



Répartition par maturité



3. Performances ETF

	1 mois	3 mois	6 mois	3 ans	5 ans
Lyxor \$ Floating Rate Note UCITS ETF - Monthly Hedged to EUR - Dist	-0,01%	-0,02%	-0,01%	-0,17%	-
Benchmark	0,02%	0,07%	0,18%	1,04%	-
Ecart de Performance	-0,03%	-0,09%	-0,19%	-1,21%	-
	YTD	2020	2019	2018	2017
Lyxor \$ Floating Rate Note UCITS ETF - Monthly Hedged to EUR - Dist	0,04%	0,10%	1,80%	-1,97%	0,33%
Benchmark	0,10%	0,48%	2,26%	-1,61%	0,54%
Ecart de Performance	-0,06%	-0,38%	-0,47%	-0,37%	-0,21%
Tracking Error	-	0,00%	0,07%	0,00%	0,00%

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 26 février 2021
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.

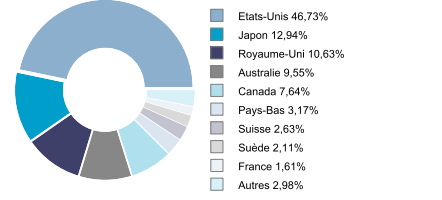
Ticker: FLOTH IM

Caractéristiques Principales du Fonds

Ticker	FLOTH IM
Enveloppe juridique	SICAV
Domiciliation	Luxembourg
UCITS	Oui
ISIN	LU1571052130
PEA	Non
Méthode de réplcation	Indirecte (via un swap)
Prêt de titres	Non
Pleine propriété des actifs	Oui
Devise de Référence	EUR
Date de Lancement	08/06/2017
VL de lancement (EUR)	100
TFE (frais/an)	0,15%
Risque de change	Non
Valeur Liquidative (EUR)	93,12
Actif Net de la part (M EUR)	38,10
Actif Net du Fonds (M EUR)	88,39
Encours SICAV (M EUR)	13 395,19
Investissement minimal (part)	1
Affectation des résultats	Distribution
Valeur du dernier détachement (EUR)	0,34
Date en cas de distribution	Juillet et Décembre
Source: Lyxor AM, 26 février 2021	

Nom	Bloomberg Barclays MSCI USD Corporate Liquid FRN 0-5 Year SRI Sustainable Index Hedged EUR
Exposition	Global
Classe d'actifs	Obligations
Type	Total Return
Devise	EUR
RIC Reuters	-
Code Bloomberg de l'indice	H34979EU
Informations complémentaires	-
Taux du coupon (%)	1,05
Yield (%)	0,36
Duration (Années)	0,15
Duration modifiée (Années)	0,16
Maturité (Années)	1,53
Convexité (%)	0,00

Allocation géographique de l'indice



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
Bloomberg Barclays US Corporate FRN 2-7 Year Total Return Index Hedged EUR	08/06/2017	09/08/2019
Bloomberg Barclays MSCI USD Corporate Liquid FRN 0-5 Year SRI Sustainable Index Hedged EUR	09/08/2019	

	1Y	3Y	5Y
Volatilité du Fonds	3,28%	1,98%	-
Volatilité de l'indice	3,28%	1,98%	-
Ratio de Sharpe	0,18	0,18	-

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.

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 DE CONTREPARTIE : Les investisseurs sont exposés aux risques découlant de l'utilisation d'un Swap de gré à gré avec J.P. Morgan Securities plc. Conformément à la réglementation OPCVM, l'exposition à JP Morgan ne peut pas dépasser 10% des actifs totaux 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 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, 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 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 \$ Floating Rate Note 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 \$ Floating Rate Note 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 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 (DIC). Le DIC 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.