

Lyxor ESG Euro Corporate Bond Ex Financials (DR) UCITS ETF - Acc

1. INFORMATIONS SUR LE FONDS

Objectif d'investissement

Le Lyxor ESG Euro Corporate Bond Ex Financials (DR) UCITS ETF - Acc est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid ex Financial SRI Sustainable Index.

Cet indice reflète la performance d'obligations de qualité investment grade, libellées en EUR et émises par des entreprises (européennes ou autres), avec des maturités supérieures ou égales à 1 an, en excluant les émetteurs financiers. L'indice exclut par ailleurs 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. Pour plus d'informations concernant cet indice, veuillez consulter : www.bloomberg.com.

Les ETF Lyxor sont des fonds d'investissement cotés en bourse qui procurent une exposition fidèle et bon marché à un indice de référence.

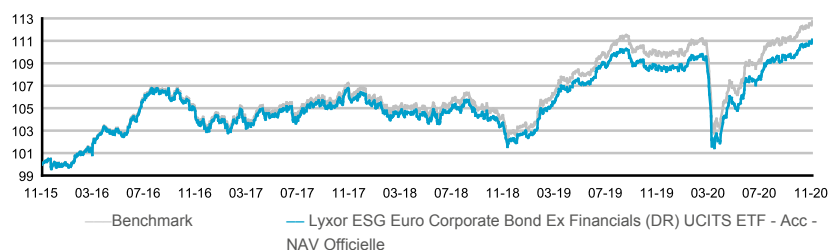
Informations sur les cotations

Place	Horaires (GMT)	Devise	Code Bloomberg	RIC Reuters	Distribution
NYSE Euronext Paris	08:00 / 16:30	EUR	CNB FP	CNB.PA	Non
Borsa Italiana (Milano)*	08:00 / 16:30	EUR	CBEF IM	CBEF.MI	Non
Deutsche Boerse (Xetra)	08:00 / 19:00	EUR	LYBF GY	LYBF.DE	Non
SIX Swiss Exchange	08:00 / 16:20	EUR	LYCNB SW	LYCNB.S	Non

* Première place de cotation pour cette classe de parts

2. Information sur l'indice

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 12 novembre 2020

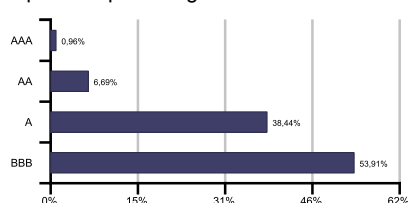


Dix principales valeurs

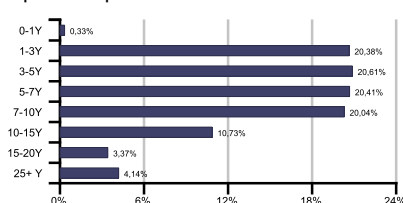
Orap 8 1/8 01/28/33	0,30%	Msf 3 1/8 12/06/28	0,23%
Total 2 5/8 12/29/49	0,27%	Vod 2 2 08/25/26	0,20%
Bpln 3 1/4 Perp	0,27%	Vz 2 7/8 01/15/38	0,20%
Bpln 3 5/8 Perp	0,24%	Tachem 3 11/21/30	0,19%
Sanfp 1 3/8 03/21/30	0,23%	Novnvx 0 09/23/28	0,19%

Nombre de composants 1202

Répartition par rating



Répartition par maturité



3. Performances ETF

	1 mois	3 mois	6 mois	3 ans	5 ans
Lyxor ESG Euro Corporate Bond Ex Financials (DR) UCITS ETF - Acc	0,82%	1,66%	5,58%	4,92%	11,10%
Benchmark	0,84%	1,73%	5,73%	6,00%	12,73%
Ecart de Performance	-0,02%	-0,07%	-0,15%	-1,08%	-1,63%
	YTD	2019	2018	2017	2016
Lyxor ESG Euro Corporate Bond Ex Financials (DR) UCITS ETF - Acc	2,55%	5,47%	-2,51%	1,07%	4,39%
Benchmark	2,80%	6,03%	-2,30%	1,29%	4,61%
Ecart de Performance	-0,25%	-0,56%	-0,22%	-0,22%	-0,22%
Tracking Error	-	0,17%	0,00%	0,00%	0,00%

Source: Bloomberg, Lyxor AM, au 12 novembre 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.

Ticker: CNB FP

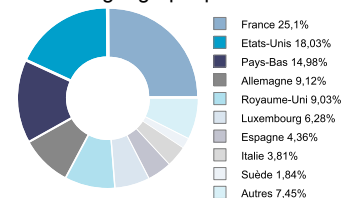
Caractéristiques Principales du Fonds

Ticker	CNB FP
Enveloppe juridique	SICAV
Domiciliation	Luxembourg
UCITS	Oui
ISIN	LU1829218822
PEA	Non
Méthode de réplcation	Directe (Physique)
Echantillonnage	Oui
Prêt de titres	Non
Devise de Référence	EUR
Date de Lancement	04/11/2009
VL de lancement (EUR)	132,9292
TFE (frais/an)	0,14%
Risque de change	Non
Valeur Liquidative (EUR)	142,07
Actif Net de la part (M EUR)	57,54
Actif Net du Fonds (M EUR)	57,54
Encours SICAV (M EUR)	38 010,93
Investissement minimal (part)	1
Affectation des résultats	Capitalisation

Source: Lyxor AM, 12 novembre 2020

Nom	Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid ex Financial SRI Sustainable Index
Exposition	Global
Classe d'actifs	Obligations
Type	Total Return
Devise	EUR
RIC Reuters	-
Code Bloomberg de l'indice	I34998EU
Informations complémentaires	-
Taux du coupon (%)	1,46
Yield (%)	0,21
Duration (Années)	5,90
Duration modifiée (Années)	6,02
Maturité (Années)	6,45
Convexité (%)	0,58

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
iBoxx € Liquid Corporates Non Financials Total Return Index	04/11/2009	15/10/2015
Market iBoxx EUR Liquid Non-Financials Mid Price TCA TRI	15/10/2015	23/08/2019
Bloomberg Barclays MSCI EUR Corporate Liquid ex Financial SRI Sustainable Index	23/08/2019	

**Jusqu'au 25/10/2018 l'historique des performances du fonds Lyxor Euro Corporate Bond Ex Financials UCITS ETF correspond aux performances de Lyxor Euro Corporate Bond Ex Financials UCITS ETF. Ce fonds a été absorbé par Lyxor Euro Corporate Bond Ex Financials UCITS ETF le 25/10/2018.

	1Y	3Y	5Y
Volatilité du Fonds	6,36%	4,28%	3,82%
Volatilité de l'indice	6,36%	4,28%	3,82%
Ratio de Sharpe	0,45	0,46	0,66

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 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 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 ESG Euro Corporate Bond Ex Financials (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 ESG Euro Corporate Bond Ex Financials (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 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.

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.