

Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR) - UCITS ETF Acc

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/05/2022

ACTION ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **197,10 (EUR)**
 Date de VL et d'actif géré : **31/05/2022**
 Actif géré : **336,61 (millions EUR)**
 Code ISIN : **LU0908501215**
 Type de Réplication : **Physique**
 Indice de référence : **100% EURO STOXX 50**
 Enveloppe fiscale : **Eligible au PEA**
 Date de la première VL : **03/04/2013**
 VL de lancement : **100,00 (EUR)**

Objectif d'investissement

Le Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR) - UCITS ETF Acc est un ETF conforme à la directive OPCVM qui cherche à reproduire la performance de l'indice de référence EURO STOXX 50 Net Return EUR.

Profil de risque et de rendement (SRRI) (Source : Fund Admin)



⚡ A risque plus faible, rendement potentiellement plus faible

⚡ A risque plus élevé, rendement potentiellement plus élevé

Le SRRI correspond au profil de risque et de rendement présent dans le Document d'Information Clé pour l'Investisseur (DICI). La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Il n'est pas garanti et pourra évoluer dans le temps.

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 réplication : 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 réplication 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 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. 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, des teneurs de marché, ou d'une situation ou d'un événement exceptionnel(le).

« Les valeurs liquidatives techniques peuvent être calculées et publiées tout jour civil (à l'exception des samedis et des dimanches) qui ne soit ni un jour ouvré ni un jour de transaction. Ces valeurs liquidatives techniques n'ont qu'une valeur indicative et ne serviront pas de base pour l'achat, la conversion, le rachat et/ou le transfert d'actions. »

Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

Evolution de la performance (VL) * (Source : Fund Admin)



Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	31/12/2021	1 mois 29/04/2022	3 mois 28/02/2022	1 an 31/05/2021	3 ans 31/05/2019	5 ans 31/05/2017	10 ans
Portefeuille	-9,71%	1,18%	-1,36%	-3,09%	25,26%	23,63%	-
Indice	-10,07%	0,87%	-1,68%	-3,77%	23,32%	20,18%	-
Ecart	0,36%	0,30%	0,32%	0,68%	1,94%	3,45%	-

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
Portefeuille	24,05%	-2,70%	28,85%	-11,40%	9,64%	4,36%	7,37%	5,00%	-	-
Indice	23,34%	-3,21%	28,20%	-12,03%	9,15%	3,72%	6,42%	4,01%	-	-
Ecart	0,70%	0,50%	0,64%	0,63%	0,49%	0,64%	0,95%	0,99%	-	-

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin) *

	1 an	3 ans
Volatilité du portefeuille	18,15%	24,37%
Volatilité de l'indice	18,17%	24,39%
Tracking Error ex-post	0,28%	0,22%
Ratio de Sharpe	-0,16	0,35

* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an.

La Tracking Error représente la volatilité annualisée des différences de performance entre l'ETF et l'indice de référence

* Source : Amundi. Les performances ci-dessus couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile. Les performances passées ne préjugent en rien des résultats actuels et futurs et ne sont pas garanties des rendements à venir. Les gains ou pertes éventuels ne prennent pas en compte les frais, commissions et redevances éventuels supportés par l'investisseur lors de l'émission et du rachat des parts (ex : taxes, frais de courtage ou autres commissions prélevés par l'intermédiaire financier...). Si les performances sont calculées dans une devise autre que l'euro, les gains ou les pertes éventuellement générés peuvent de ce fait être impactés par les fluctuations des taux de change (à la hausse comme à la baisse). L'écart correspond à la différence de performance du portefeuille et de l'indice.

ACTION ■

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'indice EURO STOXX 50 Net Return EUR est représentatif de la performance des marchés d'actions de grande capitalisation de la zone euro.

Caractéristiques (Source : Amundi)

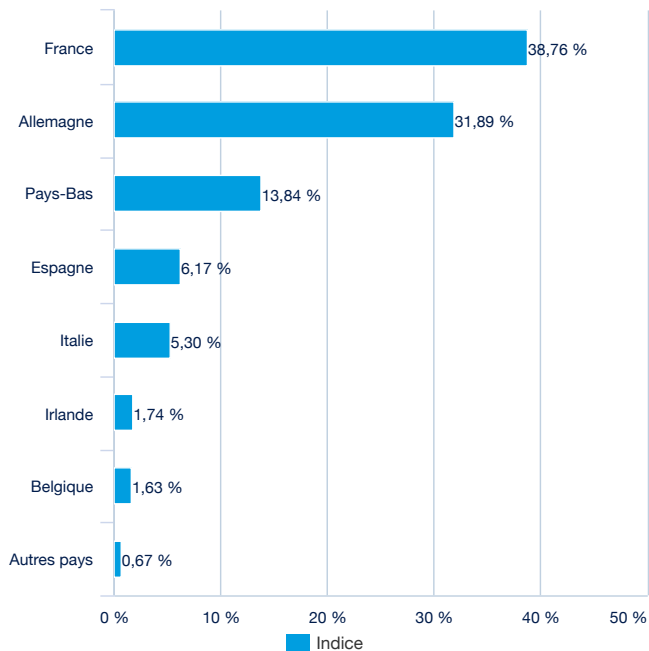
Classe d'actif : **Action**
Exposition : **Europe**

Nombre de valeurs : **50**

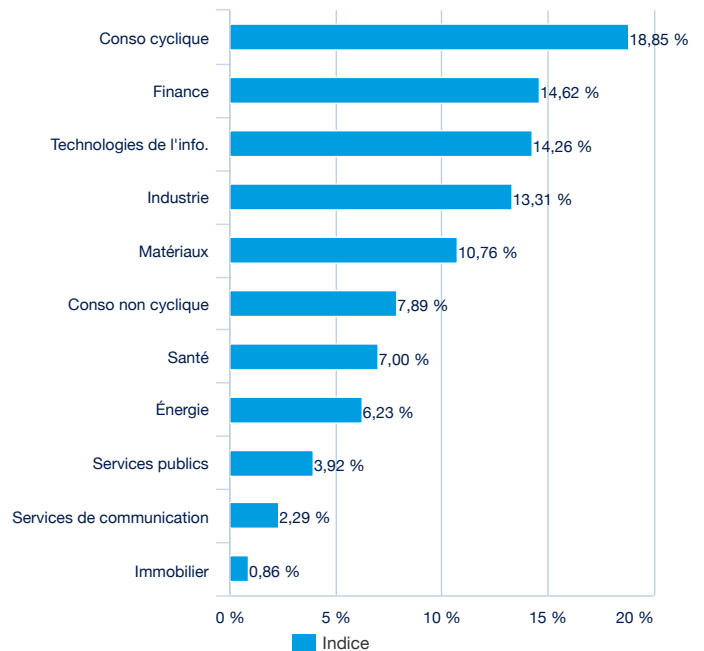
Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)
ASML HOLDING NV	7,84%
LVMH MOET HENNESSY	5,56%
LINDE PLC	5,36%
TOTALENERGIES SE PARIS	4,99%
SANOFI	3,99%
SAP SE	3,60%
SIEMENS AG-REG	3,25%
ALLIANZ SE-REG	2,83%
L OREAL	2,78%
AIR LIQUIDE SA	2,72%
Total	42,91%

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Secteurs de l'indice (source : Amundi)



ACTION ■

Données de cotation de l'ETF (source : Amundi)

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Nyse Euronext Paris	9:00 - 17:30	EUR	MSED	MSED FP	MSEDEUIV	MSED.PA	MSEDEUIV
London Stock Exchange	9:00 - 17:30	GBP	MSED	MSED LN	MSEDEUIV	MSED.L	MSEDEUIV
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	MSED	MSED IM	MSEDEUIV	MSED.MI	MSEDEUIV
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	MSED	MSED GY	MSEDEUIV	MSED.DE	MSEDEUIV
BIVA	15:30 - 22:00	MXN	MSED	MSEDN MM	-	MSEDN.MX	-

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

Forme Juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Lyxor International Asset Management S.A.S.
Valorisateur	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Dépositaire	SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG
Commissaire aux comptes	DELOITTE S.A., LUXEMBOURG
Date de création de la classe	03/04/2013
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU0908501215
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,07% (prélevés) - 22/02/2022
Frais d'entrée (maximum)	5,00%
Frais de sortie (maximum)	5,00%
Clôture fiscale	Octobre

Fournisseurs d'indices

STOXX et ses concédants de licence (les « Concédants ») n'ont aucune autre relation avec Amundi Asset Management que l'octroi de licence pour EURO STOXX 50® et les marques de commerces associées, à des fins d'utilisation en relation avec Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR).

STOXX et ses concédants :

- Ne sponsorisent pas, n'avalisent pas, ne vendent pas et ne promeuvent pas Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR).
- Ne recommandent pas à quiconque d'investir dans Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR) ni dans aucune autre action.
- N'assument aucune responsabilité et ne prennent aucune décision concernant le calendrier, les montants et la valorisation de Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR).
- N'assument aucune responsabilité quant à l'administration, à la gestion ou au marketing de Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR) .
- Ne prennent aucunement en compte les besoins de Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR) ou de ses propriétaires lors de la détermination, de la formulation ou du calcul de l'EURO STOXX 50, et n'ont aucune obligation de le faire.

STOXX et ses concédants n'assument aucune responsabilité en relation avec Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR).

En particulier :

- STOXX et ses concédants ne donnent aucune garantie, explicite ou implicite, et récusent toute garantie concernant :
- Les résultats qui doivent être réalisés par Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR), les porteurs de parts du compartiment Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR) ou tout autre personne en relation avec l'utilisation de l'EURO STOXX 50® et des données qu'il comporte ;
- L'exactitude ou l'exhaustivité de l'EURO STOXX 50 et de ses données ;
- La qualité marchande et l'adaptation à un objectif particulier, ou l'utilisation, de l'EURO STOXX 50® et de ses données ;
- STOXX et ses concédants déclinent toute responsabilité en cas d'erreur, d'omission ou d'interruption de l'EURO STOXX 50® ou de ses données ;
- STOXX et ses concédants ne pourront en aucun cas être tenus responsables de quelconques manque-à-gagner, dommages ou pertes indirects, punitifs, spéciaux ou consécutifs, quand bien même ils auraient été avisés de leur éventualité.

Le contrat de licence entre Amundi Asset Management et STOXX concerne uniquement ces derniers et aucunement les porteurs de parts du compartiment Lyxor Core EURO STOXX 50 (DR) ou d'autres tierces parties.

ACTION ■

Avertissement

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 Core EURO STOXX 50 (DR) 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 Core EURO STOXX 50 (DR) qui a obtenu l'agrément de la CSSF et a fait l'objet d'une notification auprès de l'Autorité des Marchés Financiers en vue de sa commercialisation sur le territoire français.

Amundi Asset Management (« Amundi AM ») 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 Amundi Asset Management (« Amundi AM »), Lyxor AM. Ni Amundi AM, ni Lyxor AM 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, Amundi AM et Lyxor AM 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.