

# Lyxor Smart Overnight Return - UCITS ETF C-GBP

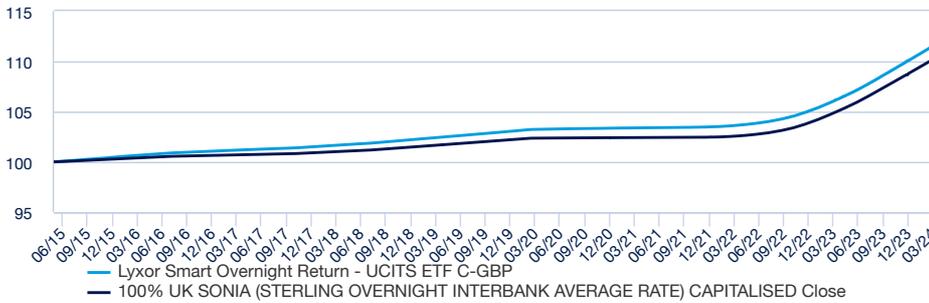
REPORTING

Communication  
Publicitaire

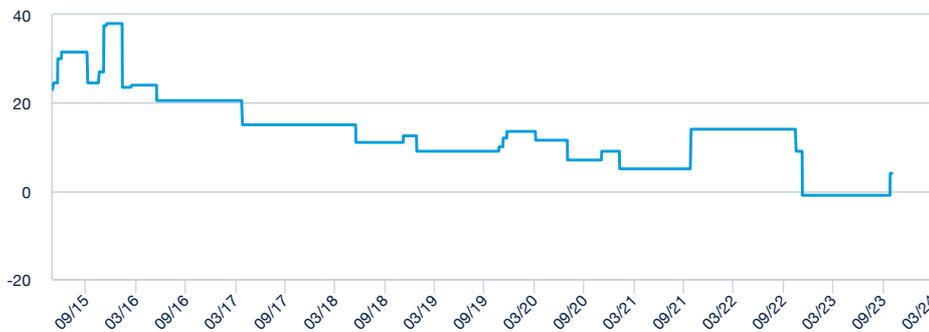
31/03/2024

OBLIGATIONS

## PERFORMANCE DEPUIS LA CREATION (Source : Fund Admin)



## PRIME ANNUALISÉE NETTE VS SONIO/N INDEX (bps)



## PERFORMANCES DU FONDS\* (Source : Fund Admin)

	MTD	3 mois	6 mois	YTD	1 an	3 ans	Depuis le lancement
Lyxor Smart Overnight Return - UCITS ETF C-GBP	-	5,24%	5,26%	5,29%	5,26%	5,20%	2,57%
100% UK SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) CAPITALISED Close	-	5,13%	5,15%	5,18%	5,15%	5,08%	2,46%

## PERFORMANCES MENSUELLES\* (Source : Fund Admin)

	Jan	Fev	Mar	Avr	Mai	Juin	Jui	Aou	Sep	Oct	Nov	Dec	AN
2015	-	-	-	-	0,00%	0,68%	0,83%	0,72%	0,77%	0,76%	0,67%	0,92%	0,77%
2016	0,81%	0,69%	0,70%	0,75%	0,66%	0,68%	0,70%	0,43%	0,45%	0,40%	0,40%	0,45%	0,60%
2017	0,39%	0,42%	0,44%	0,41%	0,33%	0,39%	0,34%	0,36%	0,39%	0,35%	0,58%	0,68%	0,43%
2018	0,56%	0,61%	0,70%	0,55%	0,58%	0,62%	0,53%	0,82%	0,81%	0,79%	0,84%	0,80%	0,69%
2019	0,79%	0,80%	0,85%	0,77%	0,83%	0,80%	0,75%	0,85%	0,75%	0,88%	0,78%	0,81%	0,82%
2020	0,87%	0,85%	0,46%	0,20%	0,18%	0,16%	0,18%	0,12%	0,12%	0,13%	0,12%	0,15%	0,30%
2021	0,13%	0,10%	0,09%	0,10%	0,09%	0,10%	0,11%	0,09%	0,10%	0,14%	0,17%	0,26%	0,13%
2022	0,31%	0,53%	0,67%	0,89%	0,95%	1,17%	1,42%	1,61%	2,07%	2,25%	2,82%	3,48%	1,55%
2023	3,10%	3,83%	4,23%	4,32%	3,92%	4,84%	4,61%	5,14%	5,62%	5,20%	5,24%	5,24%	4,78%
2024	5,24%	5,24%	5,24%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5,26%

\* Source : Fund Admin. Les performances affichées sont nettes de frais de gestion. Les performances sont annualisées sur une base de 360 jours sur une période < 1 an et 365 jours sur une période > 1 an (exprimées à l'arrondi supérieur).

## INFORMATIONS SUR LE FONDS

Structure Juridique	SICAV Luxembourgeois
UCITS Compliant	Oui
Code ISIN	LU1230136894
Méthode de répliation	Synthétique
Devise de Référence	GBP
Date de Lancement du Fonds	02/03/2015
VL de Lancement	1000 ( GBP )
TFE (frais/an)	0.05
Actif net	575,32 ( Million GBP )
Actif Net du Fonds	3 080,10 ( Million EUR )
Valeur Liquidative	1 115,49 ( GBP )
Souscription minimale ultérieure	1
Affectation des résultats	Capitalisation

Indice de Référence	100% UK SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) CAPITALISED
---------------------	---

## POINTS CLÉS

Actif Net du Fonds	2 639,03 ( millions GBP )
VL de la classe	1 115,49 GBP
Performance Annualisée	5,26%
Volatilité Annualisée	0,14%
<b>Exposition à la contrepartie *</b>	
Effective	-1.60%
Cible	< 0.00%
<b>Expected Loss (Perte Attendue) **</b>	
Effective	-0.01%
Cible	< 0.05%

\* La somme des engagements pris face à la contrepartie moins la somme des poids des titres pris comme garanties

\*\* l'Expected loss est la perte attendue liée au risque de défaut de la contrepartie. La perte attendue due au défaut de la contrepartie concernée mesure la probabilité de défaut de la contrepartie. La perte effective peut être supérieure à la perte attendue.

Notation Minimale de la Contrepartie	A-
Sensibilité	0

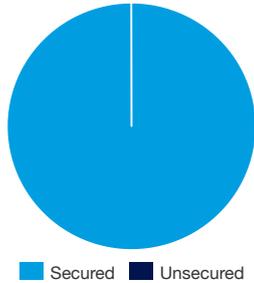
Durée de Vie Moyenne Pondérée	63
Maturité Moyenne Pondérée	0

## OBLIGATIONS ■

Les informations, données financières et recommandations contenues dans ce document ne sauraient constituer ni une offre d'achat, de vente ou de souscription d'instruments financiers, ni une offre de commercialisation, ni une offre de services financiers. Tout investisseur doit se référer aux termes et conditions du prospectus disponible sur simple demande. Ce Fonds peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays en vertu des réglementations nationales applicables à ces personnes ou dans ces pays. Il vous appartient donc de vous assurer que vous êtes autorisé à investir dans ce Fonds. Amundi Asset Management ("Amundi AM") et ses succursales déclinent toute responsabilité dans l'utilisation qui pourrait être faite de ces informations et des conséquences qui pourraient en découler. Les informations contenues dans le présent document sont communiquées à titre purement indicatif et n'ont aucune valeur contractuelle. Elles sont sujettes à des modifications, notamment en fonction des fluctuations de marché. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs.

## ANALYSE DU PORTEFEUILLE PAR TYPE D'INSTRUMENT

## PRÊTS DE TITRES SÉCURISÉS VS NON SÉCURISÉS % DE L'ACTIF NET



## Objectif d'investissement

LYXOR SMART OVERNIGHT RETURN est un fonds UCITS qui vise à réaliser, à court terme et avec une très faible volatilité, des rendements plus élevés que l'indice EuroMTS SONIO.

Le fonds est géré de façon active et investit dans un portefeuille diversifié d'instruments financiers et de pensions livrées, avec une surveillance stricte du risque et de la liquidité du portefeuille.

## 10 PRINCIPALES VALEURS

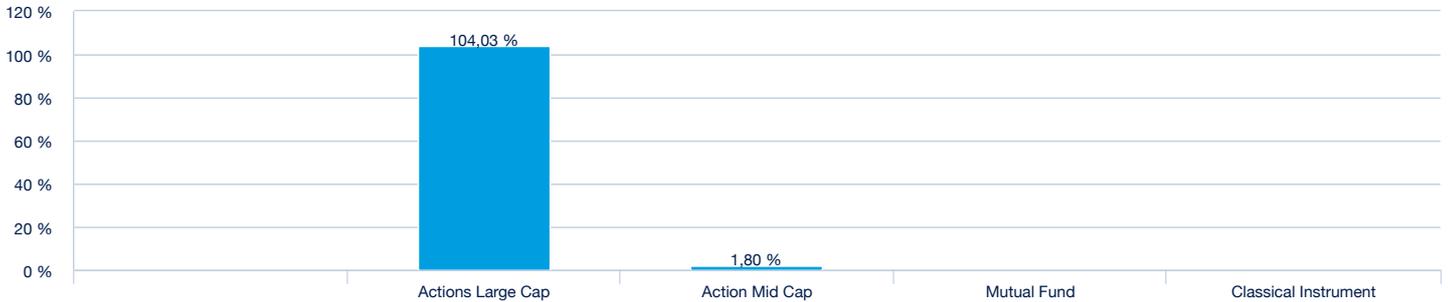
Nom	Poids	Pays	Secteur	Classe d'actifs
ASML HOLDING NV	9,06	NL	Technologie	Action
SAP SE / XETRA	7,68	DE	Technologie	Action
FAST RETAILING CO JPY50	3,69	JP	Biens de Consommation de Base	Action
JOHNSON & JOHNSON	3,68	US	Consommation Discrétionnaire	Action
NVIDIA CORP	3,61	US	Technologie	Action
VOLKSWAGEN AG-PFD	3,53	DE	Biens de Consommation de Base	Action
AMAZON.COM INC	3,53	US	Communications	Action
ALLIANZ SE-REG	3,46	DE	Finances	Action
COGNIZANT TECH SOLUTION A	3,06	US	Technologie	Action
STELLANTIS MILAN	2,86	NL	Biens de Consommation de Base	Action

Les informations, données financières et recommandations contenues dans ce document ne sauraient constituer ni une offre d'achat, de vente ou de souscription d'instruments financiers, ni une offre de commercialisation, ni une offre de services financiers. Tout investisseur doit se référer aux termes et conditions du prospectus disponible sur simple demande. Ce Fonds peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays en vertu des réglementations nationales applicables à ces personnes ou dans ces pays. Il vous appartient donc de vous assurer que vous êtes autorisé à investir dans ce Fonds. Amundi Asset Management ("Amundi AM") et ses succursales déclinent toute responsabilité dans l'utilisation qui pourrait être faite de ces informations et des conséquences qui pourraient en découler. Les informations contenues dans le présent document sont communiquées à titre purement indicatif et n'ont aucune valeur contractuelle. Elles sont sujettes à des modifications, notamment en fonction des fluctuations de marché. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs.

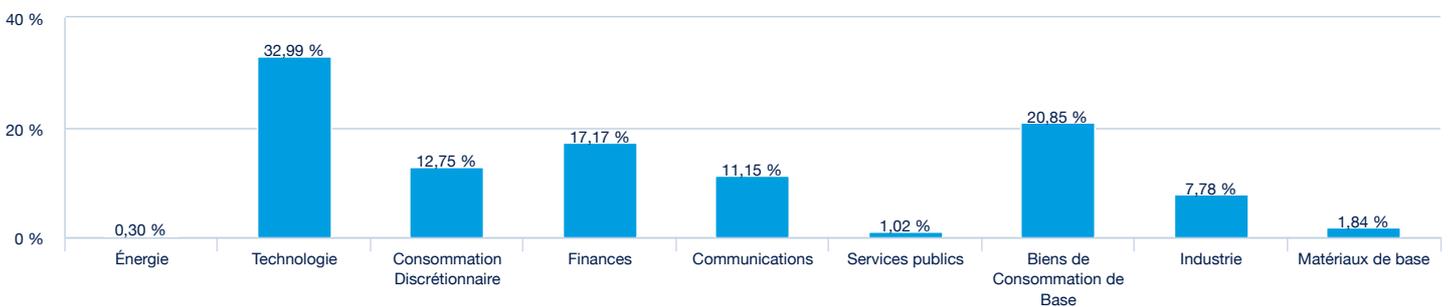
## OBLIGATIONS ■

## ANALYSE DU PANIER D'ACTIONS UTILISEES COMME GARANTIES

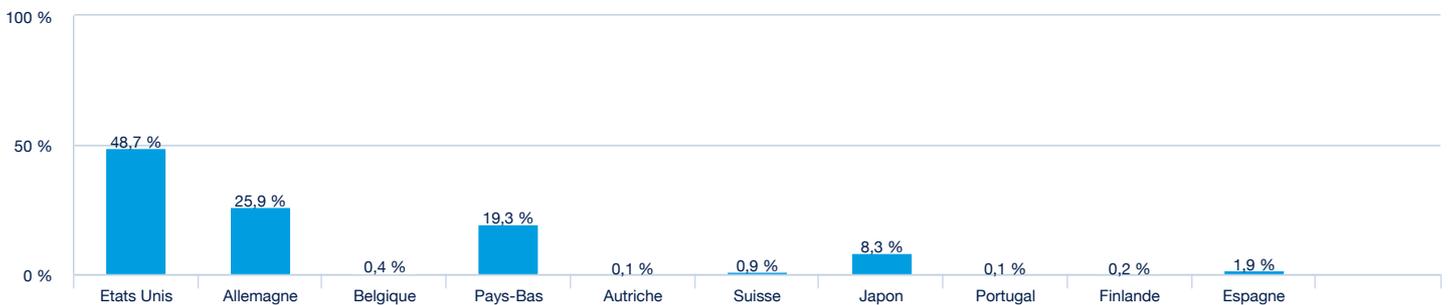
## ALLOCATION CATEGORIELLE DES TITRES



## ALLOCATION SECTORIELLE DES TITRES



## ALLOCATION GEOGRAPHIQUE DES TITRES



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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Six Swiss Exchange	9:00 - 17:30	GBP	CSH2	LYSMG SW	LYSMGBIV	LYSMG.S	LYSMGBIV
London Stock Exchange	9:00 - 17:30	GBP	CSH2	CSH2 LN	LYSMGBIV	LYCSH2.L	LYSMGBIV

Les informations, données financières et recommandations contenues dans ce document ne sauraient constituer ni une offre d'achat, de vente ou de souscription d'instruments financiers, ni une offre de commercialisation, ni une offre de services financiers. Tout investisseur doit se référer aux termes et conditions du prospectus disponible sur simple demande. Ce Fonds peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays en vertu des réglementations nationales applicables à ces personnes ou dans ces pays. Il vous appartient donc de vous assurer que vous êtes autorisé à investir dans ce Fonds. Amundi Asset Management ("Amundi AM") et ses succursales déclinent toute responsabilité dans l'utilisation qui pourrait être faite de ces informations et des conséquences qui pourraient en découler. Les informations contenues dans le présent document sont communiquées à titre purement indicatif et n'ont aucune valeur contractuelle. Elles sont sujettes à des modifications, notamment en fonction des fluctuations de marché. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs.