

# LYXOR PEA OBLIGATIONS D'ÉTAT EURO UCITS ETF

information  
périodique

COMPARTIMENT DE LA SICAV MULTI UNITS FRANCE

*Le document d'information périodique ne fait pas l'objet d'une certification par le Commissaire aux comptes de l'OPC.*

Information Périodique au 29.04.2022

## État du patrimoine

| Éléments de l'état du patrimoine   | Devise de comptabilité de l'OPC : EUR | Montant à l'arrêté périodique |
|--|---------------------------------------|-------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L.214-20 / 1° du I de l'article L.214-24-55 du code monétaire et financier |                                       | 8 385 899,52                  |
| b) Avoirs bancaires  |                                       | -                             |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC   |                                       | 8 782 667,68                  |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)   |                                       | <b>17 168 567,20</b>          |
| e) Passif  |                                       | -8 748 446,21                 |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net OPC)  |                                       | <b>8 420 120,99</b>           |

## Nombre de parts ou actions en circulation et valeur nette d'inventaire par part ou action

| Parts ou actions            | Nombre de parts ou actions en circulation | Devise parts ou actions | Valeur nette d'inventaire par part ou action (Valeur Liquidative) |
|-----------------------------|---|-------------------------|---|
| ACTIONS ACC. / FR0013346681 | 864 000                                   | EUR                     | 9,7455  |

## Tracking error

L'écart de suivi («tracking error») est calculé sur une période de 52 semaines.

| Parts ou actions            | Tracking error |
|-----------------------------|----------------|
| ACTIONS ACC. / FR0013346681 | 0,011%         |

## Portefeuille titres

| Éléments du portefeuille titres   | Pourcentage |                  |
|---|-------------|------------------|
|   | Actif net   | Total des actifs |
| a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1° du code monétaire et financier.<br><br>et b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.                  | 82,00       | 40,21            |
| c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale. | 17,59       | 8,63             |
| d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.  | -           | -                |
| e) Les autres actifs  | -           | -                |

## Répartition des actifs par devise

| Devises (10 principales devises) | Montant<br><i>En devise de comptabilité<br/>de l'OPC</i> | Pourcentage  |                  |
|----------------------------------|--|--------------|------------------|
|                                  | EUR  | Actif net    | Total des actifs |
| EUR                              | 2 765 492,62   | 32,84        | 16,10            |
| SEK                              | 2 663 965,40   | 31,64        | 15,52            |
| USD                              | 1 480 949,19   | 17,59        | 8,63             |
| NOK                              | 1 475 492,31   | 17,52        | 8,59             |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| Autres devises                   | -  | -            | -                |
| <b>Total</b>                     | <b>8 385 899,52</b>                                      | <b>99,59</b> | <b>48,84</b>     |

## Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

| Pays (10 principaux pays) | Pourcentage  |                  |
|---------------------------|--------------|------------------|
|                           | Actif net    | Total des actifs |
| Suède                     | 31,65        | 15,50            |
| Etats-Unis d'Amérique     | 17,59        | 8,63             |
| Norvège                   | 17,52        | 8,59             |
| Pays-Bas                  | 14,63        | 7,18             |
| Autriche                  | 6,84         | 3,36             |
| Finlande                  | 5,84         | 2,87             |
| Allemagne                 | 3,45         | 1,69             |
| Belgique                  | 2,07         | 1,02             |
| -                         | -            | -                |
| -                         | -            | -                |
| Autres pays               | -            | -                |
| <b>Total</b>              | <b>99,59</b> | <b>48,84</b>     |

## Répartition des actifs par secteur économique

| Secteur économique (10 principaux secteurs) | Pourcentage  |                  |
|---|--------------|------------------|
|   | Actif net    | Total des actifs |
| Services de télécommunications              | 12,74        | 6,26             |
| Banques                                     | 9,31         | 4,56             |
| Équipements et services pétroliers          | 8,84         | 4,34             |
| Sociétés pétrolières et gazières intégrées  | 8,10         | 3,97             |
| Matières industrielles                      | 6,91         | 3,39             |
| Composants électroniques                    | 6,52         | 3,20             |
| Services numériques aux consommateurs       | 6,51         | 3,19             |
| Pharmacie                                   | 6,14         | 3,01             |
| Logiciels                                   | 5,91         | 2,90             |
| Aluminium                                   | 4,61         | 2,26             |
| Autres secteurs                             | 24,00        | 11,76            |
| <b>Total</b>                                | <b>99,59</b> | <b>48,84</b>     |

## Ventilation des autres actifs par nature

| Nature d'actifs   | Pourcentage |                  |
|---|-------------|------------------|
|   | Actif net   | Total des actifs |
| PARTS OU ACTIONS D'OPCVM :  | -           | -                |
| - Fonds professionnels à vocation générale                                    | -           | -                |
| - OPCVM nourriciers   | -           | -                |
| - Fonds professionnels spécialisés  | -           | -                |
| - Fonds de capital investissement (FCPR, FCPI, FIP)                           | -           | -                |
| - OPCI et OPPCI (Organismes Professionnels de Placement Collectif Immobilier) | -           | -                |
| - Autres  | -           | -                |
| AUTRE NATURE D'ACTIFS :   | -           | -                |
| - Bons de souscription  | -           | -                |
| - Bons de caisse  | -           | -                |
| - Billets à ordre   | -           | -                |
| - Billets hypothécaires   | -           | -                |
| - Autres  | -           | -                |
| <b>TOTAL</b>  | <b>-</b>    | <b>-</b>         |

## Indication des mouvements intervenus dans la composition du portefeuille titres, au cours de la période de référence

| Éléments du portefeuille titres   | Mouvements<br>(en montant) |                              |
|---|----------------------------|------------------------------|
|   | Acquisitions               | Cessions /<br>Remboursements |
| <i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>  |                            |                              |
| a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1° du code monétaire et financier.  |                            |                              |
| et b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.  | 21 715 237,83              | 20 780 450,53                |
| c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale. | 1 776 483,55               | 1 639 076,78                 |
| d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.  | -                          | -                            |
| e) Les autres actifs  | -                          | -                            |
| <b>Total sur la période</b>   | <b>23 491 721,38</b>       | <b>22 419 527,31</b>         |

## Frais de gestion

| Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période | Montant | % |
|--|---------|---|
| Catégorie de part :  |         |   |
| ACTIONS ACC. / FR0013346681  | -       | - |
| -  | -       | - |

## Indication des données chiffrées relatives aux distributions unitaires sur résultat et/ou sur plus ou moins-values nettes réalisées (« PVNR »), versées au cours de la période ou à verser, après déduction des impôts

| Date | Catégorie de parts/actions | Devise parts/actions | Nature | Montant net unitaire | Crédit d'impôt unitaire | Montant brut unitaire |
|------|----------------------------|----------------------|--------|----------------------|-------------------------|-----------------------|
| -    | -                          | -                    | -      | -                    | -                       | -                     |
| -    | -                          | -                    | -      | -                    | -                       | -                     |
| -    | -                          | -                    | -      | -                    | -                       | -                     |
| -    | -                          | -                    | -      | -                    | -                       | -                     |
| -    | -                          | -                    | -      | -                    | -                       | -                     |
| -    | -                          | -                    | -      | -                    | -                       | -                     |

# Transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers règlement SFTR (en devise de comptabilité de l'OPC)

## 1. Informations générales

### 1.1. Montant des titres et matières premières prêtés en proportion du total des actifs pouvant être prêtés définis comme excluant la trésorerie et les équivalents de trésorerie

| Prêts de titres     |   |
|---------------------|---|
| % des actifs prêtés | - |

### 1.2. Montant des actifs engagés dans chaque type d'opération de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global exprimés en valeur absolue (dans la monnaie de l'organisme de placement collectif) et en proportion des actifs sous gestion de l'organisme de placement collectif

|                           | Prêts de titres <sup>(1)</sup> | Emprunts de titres <sup>(2)</sup> | Mises en pension <sup>(3)</sup> | Prises en pension <sup>(4)</sup> | TRS <sup>(5)</sup> |
|---------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|--------------------|
| Valeur absolue            | -                              | -                                 | -                               | -                                | 8 420 120,99       |
| % des actifs sous gestion | -                              | -                                 | -                               | -                                | 100,00             |

<sup>(1)</sup> Le montant des actifs engagés dans les opérations de prêts de titres correspond à la valeur de marché des titres prêtés en date de clôture comptable.

<sup>(2)</sup> Le montant des actifs engagés dans les opérations d'emprunts de titres correspond à la valeur de marché des garanties (espèces ou titres) livrées par le fonds dans le cadre de l'emprunt de titres en date de clôture comptable.

<sup>(3)</sup> Le montant des actifs engagés dans les opérations de mise en pension correspond à la valeur de marché des titres mis en pension en date de clôture comptable.

<sup>(4)</sup> Le montant des actifs engagés dans les opérations de prise en pension correspond à la valeur de marché des titres pris en pension en date de clôture comptable.

<sup>(5)</sup> Le montant des actifs engagés dans les TRS correspond (i) pour les TRS pour lesquels la société de gestion s'est engagée à livrer un panier de titres à la contrepartie du TRS, à la valeur de marché du panier de titres engagés dans les TRS, augmentée de la valeur de marché du TRS en date de clôture comptable et/ou (ii) pour les TRS pour lesquels la société de gestion ne livre pas de panier de titres, à la valeur du nominal du TRS en date de clôture comptable.

## 2. Données sur la concentration

### 2.1. Les dix plus gros émetteurs de garanties pour tous les types d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global (ventilation des volumes de garanties et de matières premières reçus par noms d'émetteurs)

|   |              |   |
|---|--------------|---|
| 1 | Dénomination | - |
|   | Montant      | - |

### 2.2. Les dix principales contreparties pour chaque type d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global séparément (nom de la contrepartie et volume brut des opérations en cours)

|   | Prêts de titres | Emprunts de titres | Mises en pension | Prises en pension | TRS              |
|---|-----------------|--------------------|------------------|-------------------|------------------|
| 1 | Dénomination    | -                  | -                | -                 | SOCIETE GENERALE |
|   | Montant         | -                  | -                | -                 | 8 420 120,99     |



### 3. Données d'opération agrégées pour chaque type d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global séparément à ventiler en fonction des catégories suivantes

#### 3.1. Type et qualité des garanties

|       | Prêts de titres | Emprunts de titres | Mises en pension | Prises en pension | TRS |
|-------|-----------------|--------------------|------------------|-------------------|-----|
| Cash  | -               | -                  | -                | -                 | -   |
| Titre | -               | -                  | -                | -                 | -   |

LIAM veille à assurer une bonne diversification des titres reçus en garantie et veille également à rehausser la valeur de ses garanties en appliquant des décotes de valorisation sur les titres reçus.

#### 3.2. Échéance de la garantie

|                    | Prêts de titres | Emprunts de titres | Mises en pension | Prises en pension | TRS |
|--------------------|-----------------|--------------------|------------------|-------------------|-----|
| Moins d'1 jour     | -               | -                  | -                | -                 | -   |
| 1 jour à 1 semaine | -               | -                  | -                | -                 | -   |
| 1 semaine à 1 mois | -               | -                  | -                | -                 | -   |
| 1 à 3 mois         | -               | -                  | -                | -                 | -   |
| 3 mois à 1 an      | -               | -                  | -                | -                 | -   |
| Plus d'1 an        | -               | -                  | -                | -                 | -   |
| Ouvertes           | -               | -                  | -                | -                 | -   |

#### 3.3. Monnaie de la garantie

|           | Prêts de titres | Emprunts de titres | Mises en pension | Prises en pension | TRS |
|-----------|-----------------|--------------------|------------------|-------------------|-----|
| 1 Monnaie | -               | -                  | -                | -                 | -   |
| Montant   | -               | -                  | -                | -                 | -   |

#### 3.4. Échéance des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global

|                    | Prêts de titres | Emprunts de titres | Mises en pension | Prises en pension | TRS          |
|--------------------|-----------------|--------------------|------------------|-------------------|--------------|
| Moins d'1 jour     | -               | -                  | -                | -                 | -            |
| 1 jour à 1 semaine | -               | -                  | -                | -                 | -            |
| 1 semaine à 1 mois | -               | -                  | -                | -                 | -            |
| 1 à 3 mois         | -               | -                  | -                | -                 | -            |
| 3 mois à 1 an      | -               | -                  | -                | -                 | 8 420 120,99 |
| Plus d'1 an        | -               | -                  | -                | -                 | -            |
| Ouvertes           | -               | -                  | -                | -                 | -            |

#### 3.5. Pays où sont établies les contreparties

|         | Prêts de titres | Emprunts de titres | Mises en pension | Prises en pension | TRS          |
|---------|-----------------|--------------------|------------------|-------------------|--------------|
| 1 Pays  | -               | -                  | -                | -                 | FRANCE       |
| Montant | -               | -                  | -                | -                 | 8 420 120,99 |

### 3.6. Règlement et compensation

|                       | Prêts de titres | Emprunts de titres | Mises en pension | Prises en pension | TRS          |
|-----------------------|-----------------|--------------------|------------------|-------------------|--------------|
| Tri-parties           | -               | -                  | -                | -                 | -            |
| Contrepartie centrale | -               | -                  | -                | -                 | -            |
| Bilatéraux            | -               | -                  | -                | -                 | 8 420 120,99 |

### 4. Données sur la réutilisation des garanties (collateral)

Ce fonds n'est pas collatérisé.

### 5. Conservation des garanties reçues par l'organisme de placement collectif dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global

|                        |   |
|------------------------|---|
| Nombre de dépositaires | - |
| 1 Dénomination         | - |
| Montant                | - |

### 6. Conservation des garanties fournies par l'organisme de placement collectif dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global

Non applicable.

### 7. Données sur les revenus et les coûts de chaque type d'opération de financement sur titres et de contrat d'échange sur rendement global

L'OPC a recours à des contrats d'échange sur rendement global (TRS) négociés de gré à gré.

Les revenus et les coûts liés aux contrats d'échange sur rendement global sont inclus dans l'évaluation de ces contrats.