

DATOS FUNDAMENTALES PARA EL INVERSOR

El presente documento recoge los datos fundamentales sobre este fondo que el inversor debe conocer. No se trata de material promocional. La ley exige que se le facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del fondo y los riesgos que comporta invertir en él. Le recomendamos que la lea para que, de esta manera, pueda tomar una decisión fundada sobre la inversión.

Lyxor Smart Overnight Return - UCITS ETF C-EUR (en lo sucesivo, el "Fondo")

ISIN: LU1190417599 - Un subfondo de la sociedad de inversión denominada Lyxor Index Fund (en lo sucesivo, la "Sociedad"), con domicilio sito en Luxemburgo. Gestionado por Amundi Asset Management, sociedad de Amundi Group

Objetivos y política de inversión

El Fondo es un fondo UCITS de gestión activa.

El objetivo de inversión del Fondo es generar una rentabilidad vinculada a los tipos del mercado monetario. El Fondo está referenciado al €STR al tipo compuesto (en lo sucesivo, el "Índice de referencia"). El Fondo se gestiona activamente invirtiendo en una cartera diversificada de instrumentos financieros con un estricto control de la liquidez y los riesgos. La mayor parte de las inversiones o exposición del Fondo está vinculada al Índice de referencia. La estrategia de inversión del Fondo está vinculada al Índice de referencia y cualquier error de réplica del Índice de referencia está limitado.

El €STR (tipo del euro a corto plazo) refleja los costes de empréstito mayorista en euros no garantizados a un día de los bancos ubicados en la zona euro. El €STR utiliza datos de transacciones de los informes diarios de cambio de divisa redactados por los 52 bancos más grandes de la zona euro. Se trata del tipo de interés medio de los préstamos realizados durante el día.

El BCE calcula y publica el €STR compuesto diario. El €STR se publica cada día hábil en función de las transacciones realizadas y liquidadas el día hábil anterior (la fecha de informe "T") con una fecha de vencimiento de T+1 que se considera que se han ejecutado en condiciones de igualdad y, por lo tanto, reflejan los tipos del mercado sin sesgos.

El Fondo no se beneficia de ninguna garantía implícita o explícita, ni de una contraparte de la permuta ni de ninguna entidad que actúe como distribuidor del Fondo.

Cabe la posibilidad de que el tipo de referencia del €STR sea negativo, lo que podría hacer que el Fondo arrojará una rentabilidad negativa.

Puede consultar la composición actualizada de las participaciones del Fondo en la web www.amundiETF.com.

Asimismo, el valor liquidativo indicativo se difunde a través de las páginas del Fondo en Reuters y Bloomberg, y es posible que también se difunda a través de las páginas web de las bolsas en las que cotice el Fondo.

La divisa de la clase del fondo es el euro (EUR).

- **Instrumentos financieros en los que se invierte:** para lograr su objetivo de inversión, el universo de inversión del Subfondo está compuesto por: - Instrumentos del mercado monetario, incluidos depósitos en instituciones crediticias, - Valores mobiliarios (incluidas acciones, instrumentos de deuda con cupones fijos o variables) o participaciones o acciones de OICVM autorizados de conformidad con la Directiva de OICVM, - Instrumentos financieros derivados, incluidos de manera específica: swaps del mercado monetario, operaciones con divisas a plazo y con swaps de divisas, estrictamente concebidas para proporcionar cobertura a los riesgos de cambio, y operaciones con swaps de tipos de interés destinadas a reducir los riesgos de tipos.
- Técnicas de gestión eficiente de la cartera, como por ejemplo: préstamo de títulos y toma en préstamo de valores, operaciones con pactos de recompra y recompra inversa sobre valores mobiliarios (incluidas acciones e instrumentos de deuda a tipo fijo o variable).
El Subfondo también podrá mantener efectivo.
- **Política de dividendos:** las cuantías del Fondo disponibles para su distribución (si las hubiera) no se distribuirán entre los Accionistas, sino que se reinvertirán.
- **Valor de inventario neto:** El Valor de inventario neto por acción se calcula cada Día de valoración.
- **Reembolsos:** las solicitudes de reembolso deben recibirse a las 13:00 (hora de Luxemburgo) o antes de cada Día de valoración (D). Para obtener más información, consulte el folleto del Fondo.

Perfil de riesgo y remuneración



La categoría riesgo-remuneración que se muestra más arriba está basada en la rentabilidad histórica de los activos incluidos en el Fondo o en la de su índice de referencia o en la de un modelo de cartera. Por consiguiente, es posible que la estimación del riesgo no constituya un indicador fiable del riesgo futuro y esté sujeta a variación a lo largo del tiempo. La asignación a la categoría más baja no significa que la inversión esté libre de riesgo.

Como consecuencia de su exposición al Índice de referencia, el Fondo ha sido clasificado dentro de la categoría 1. La categoría 1 indica que la pérdida del capital es posible, aunque sea muy improbable en condiciones normales de mercado.

Principales riesgos no cubiertos por el indicador anterior que podrían llevar a un descenso del valor liquidativo del Fondo y sobre los que el Fondo está autorizado a informar en el presente documento (para más información sobre los riesgos, consulte la sección de Perfil de Riesgo del folleto):

- **Riesgo de contraparte:** El Fondo está expuesto al riesgo de que cualquier contraparte con la que haya formalizado un contrato o transacción pueda declararse insolvente o en otra situación de impago y, más concretamente, en la ejecución de instrumentos financieros derivados negociados en mercados extrabursátiles (OTC) u operaciones de préstamo de valores. Si se produce tal suceso, el valor liquidativo del Fondo puede disminuir significativamente. Según el reglamento aplicable al Fondo, este riesgo no puede superar el 10 % de los activos totales del Fondo por contraparte.
- **Riesgo de instrumentos financieros derivados:** El Fondo invierte en instrumentos financieros derivados. Estos instrumentos financieros derivados pueden llevar aparejados diferentes tipos de riesgos, por ejemplo (sin carácter restrictivo) el riesgo de apalancamiento, el riesgo de volatilidad elevada, el riesgo de valoración o el riesgo de liquidez. Si se materializa alguno de estos riesgos, el valor liquidativo del Fondo puede disminuir significativamente.
- **Riesgo operativo:** En caso de fallo operativo por parte de la sociedad gestora o uno de sus representantes, los inversores podrían sufrir pérdidas, retrasos en la tramitación de las suscripciones, conversiones, órdenes de reembolso u otras molestias.
- **Riesgo de crédito:** El Fondo está expuesto al riesgo de que cualquier emisor pueda declararse insolvente o a cualquier otra situación que pueda afectar a la calidad crediticia de dicho emisor. Este riesgo o situación podría generar un descenso del valor liquidativo del Fondo.

Gastos del Fondo

Los gastos que usted soporta están destinados a sufragar los costes de gestión del Fondo, incluidos los de comercialización y distribución. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de su inversión. Si desea más información sobre los gastos, consulte la sección de gastos correspondiente del folleto del Fondo que se encuentra disponible en www.amundiETF.com.

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión

Gastos de entrada: No aplicable para inversores del mercado secundario*

Gastos de salida: No aplicable para inversores del mercado secundario*

Este es el máximo que puede detrarse de su capital antes de proceder a la inversión y antes de que se abone el producto de su inversión.

***Mercado secundario:** puesto que el Fondo es un ETF, los inversores que no sean participantes autorizados, por lo general, solamente podrán comprar o vender valores del mercado secundario. Por consiguiente, los inversores pagarán comisiones de corretaje y/o costes de transacción vinculados a las operaciones que realicen en la bolsa. Estas comisiones de corretaje y/o costes de transacción no las cobra el Fondo o la Sociedad gestora, sino que deben abonarse al propio intermediario del inversor. Además, los inversores también podrán tener que abonar los costes de la horquilla de precios de compra y venta, lo que significa que los precios a los que los valores pueden comprarse y venderse serán diferentes.

Mercado primario: Los participantes autorizados que operen directamente con el Fondo pagarán costes de transacción del mercado primario.

Si desea más información, consulte las secciones correspondientes en el folleto del Fondo.

Gastos detrados del Fondo a lo largo de un año.

Gastos corrientes: 0,05 %.

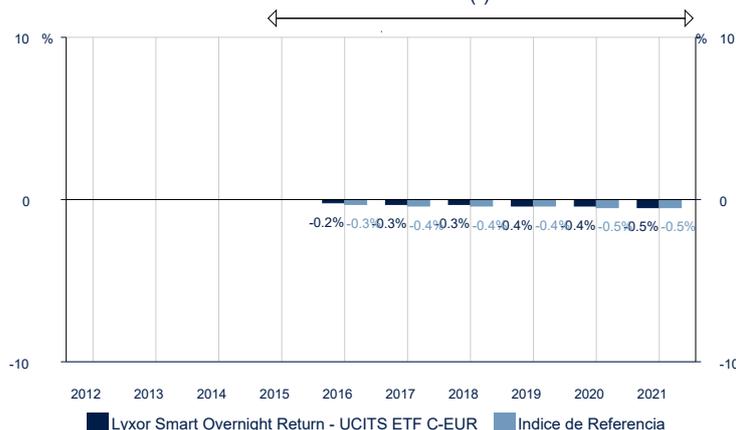
La tasa de gastos corrientes se basa en los gastos del año pasado (incluidos impuestos, si procede) para el ejercicio cerrado en octubre de 2021, y podría variar de un año a otro. No incluye las comisiones de rentabilidad ni los costes de operación de la cartera, salvo en caso de que el Fondo haya abonado un gasto de entrada/salida al comprar o vender participaciones o acciones de instituciones de inversión colectiva subyacentes.

Gastos detrados del Fondo en determinadas condiciones específicas

Comisión de rentabilidad: No aplicable.

Rentabilidad histórica

Rentabilidad anual del
Lyxor Smart Overnight Return - UCITS ETF C-EUR (en %)
(*)



La rentabilidad histórica no es un indicador fiable de la rentabilidad futura. La rentabilidad se indica en euros (EUR) y libre de todas las comisiones que deba sufragar el Fondo. El Fondo se constituyó el 2 de marzo de 2015.

Cuando el Índice de referencia está denominado en una divisa distinta a la del Fondo, el rendimiento del Índice de referencia se convierte a la divisa del Fondo a efectos de comparación. Las transacciones del mercado de divisas se ejecutan diariamente (tipo de cambio de WM Reuters de 17:00 en la fecha correspondiente).

(*) Del 2 de marzo de 2015 al 31 de diciembre de 2021, el Índice de referencia utilizado a efectos de comparación de la rentabilidad era el EONIA al tipo compuesto. Desde el 1 de enero de 2022, el Índice de referencia es el ESTR al tipo compuesto.

Información práctica

■ Depositario: Soci t  G n rale Luxembourg.

Dispone de otra informaci n pr ctica sobre el Fondo, la  ltima versi n del folleto y los  ltimos informes anuales, as  como cualquier informe semestral posterior (en franc s o ingl s) de forma gratuita a trav s del departamento de atenci n al cliente de la sociedad gestora, en la direcci n 91-93, boulevard Pasteur, 75015 Par s, FRANCIA.

El Fondo es un subfondo de la Sociedad Lyxor Index Fund. El folleto, los  ltimos informes anuales y cualquier informe semestral posterior se preparan para toda la Sociedad.

Los activos y pasivos de cada Subfondo est n segregados por ley (es decir, los activos del Fondo no pueden ser utilizados para hacer frente a los pasivos de otros subfondos de la Sociedad). Si procede, las normas de conversi n entre subfondos se detallan en el folleto en la Sociedad.

■ Informaci n adicional: el valor liquidativo y otra informaci n sobre las clases de participaciones (en su caso) est n disponibles en www.amundiETF.com.

Podr  acceder a informaci n sobre creadores de mercado, bolsas de valores y dem s datos de negociaci n en la p gina dedicada al Fondo en la web www.amundiETF.com. El valor liquidativo indicativo es publicado en tiempo real por la bolsa de valores durante el horario de negociaci n.

■ Fiscalidad: la legislaci n fiscal aplicable en el Estado miembro en que el Fondo est  registrado puede afectar a los inversores. P ngase en contacto con su asesor fiscal habitual para obtener informaci n adicional.

Amundi Asset Management  nicamente incurrir  en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten enga osas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto del Fondo.

La informaci n detallada sobre la pol tica de remuneraci n actualizada de la sociedad gestora puede consultarse en www.amundiETF.com o sin coste alguno previa solicitud por escrito a la sociedad gestora. Esta pol tica describe, en particular, los m todos de c lculo de la remuneraci n y los beneficios de determinadas categor as de empleados, los organismos encargados de su asignaci n y la composici n del Comit  de remuneraci n.

El Fondo est  autorizado en Luxemburgo y supervisado por la Comisi n de Supervisi n del Sector Financiero (Commission de Surveillance du Secteur Financier, CSSF). Amundi Asset Management est  regulada por la Autoridad de los Mercados Financieros francesa (Autorit  des March s Financiers, AMF).

Los presentes datos fundamentales para el inversor son exactos y est n actualizados a 1 junio 2022.