

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-USD (en lo sucesivo, el "Fondo")

ISIN: LU1248511575 - 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 tipo compuesto de los fondos federales (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 de todos los activos interbancarios a un día creados antes del cierre de los sistemas RTGS, a las 18:00 CET y publicados a través de Thomson Reuters a diario, antes de las 19:00 CET.

El tipo de los fondos federales es el tipo de interés efectivo a un día calculado como la media ponderada de todas las operaciones de préstamo no garantizadas a un día en el mercado interbancario en dólares. El cálculo de los tipos de referencia de los fondos federales es realizado por la Fed, en función de todos los activos interbancarios a un día creados antes del cierre de los sistemas RTGS, a las 18:00 CET y publicados a través de Thomson Reuters a diario, antes de las 19:00 CET.

Los tipos compuestos diarios de los fondos federales integran el efecto de la reinversión de los intereses percibidos según la metodología OIS (permutas indexadas a un día).

El Compartimento no disfruta de ninguna garantía implícita o explícita, ni de una contraparte de la permuta (Société Générale), ni de ninguna entidad que actúe como distribuidor del Compartimento.

Cabe la posibilidad de que el tipo de referencia de los fondos federales 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 dólar estadounidense (USD).

- 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:** los inversores podrán obtener el reembolso de sus acciones en el mercado primario todos los días de valoración antes de las 13:00 hora de Europa central/Luxemburgo y vender sus acciones en el mercado secundario en cualquier momento dentro del horario de negociación de las plazas de cotización 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 detraídos del Fondo a lo largo de un año.

Gastos corrientes: 0,09 %.

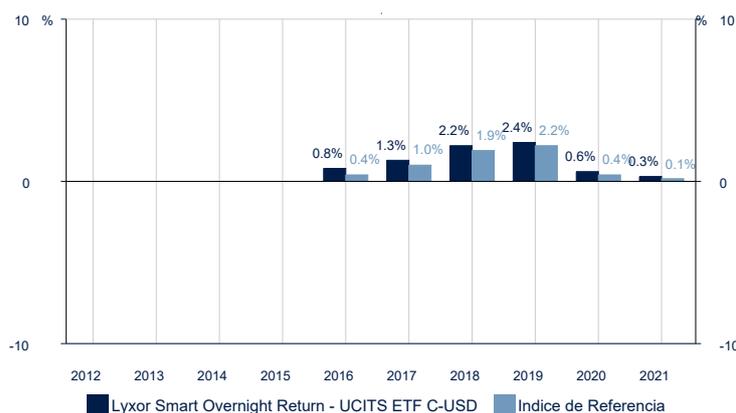
Este porcentaje de gastos corrientes es una estimación de los gastos. Esta estimación refleja la disminución de la comisión de gestión vigente a partir del 5 de febrero de 2021. La cifra que aquí se indica corresponde al porcentaje aplicado después de dicha fecha, que variará respecto a los gastos exactos cobrados durante todo el año, incluido el periodo previo a la modificación. El informe anual del UCITS correspondiente a cada ejercicio presentará de manera pormenorizada los gastos exactos cobrados. 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 detraídos del Fondo en determinadas condiciones específicas

Comisión de rentabilidad: No aplicable.

Rentabilidad histórica

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



La rentabilidad histórica no es un indicador fiable de la rentabilidad futura. La rentabilidad se indica en dólares estadounidenses (USD) y libre de todas las comisiones que deba sufragar el Fondo. El Fondo se constituyó el 30 de junio de 2015.

Cuando el Índice de referencia está denominados 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).

Información práctica

- **Depositario:** Société Générale Luxembourg.

Dispone de otra información práctica sobre el Fondo, la última versión del folleto y los últimos informes anuales, así como cualquier informe semestral posterior (en francés o inglés) de forma gratuita a través del departamento de atención al cliente de la sociedad gestora, en la dirección 91-93, boulevard Pasteur, 75015 París, FRANCIA.

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

Los activos y pasivos de cada Subfondo están 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 conversión entre subfondos se detallan en el folleto en la Sociedad.

- **Información adicional:** el valor liquidativo y otra información sobre las clases de participaciones (en su caso) están disponibles en www.amundiETF.com.

Podrá acceder a información sobre creadores de mercado, bolsas de valores y demás datos de negociación en la página 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 negociación.

- **Fiscalidad:** la legislación fiscal aplicable en el Estado miembro en que el Fondo esté registrado puede afectar a los inversores. Póngase en contacto con su asesor fiscal habitual para obtener información adicional.

Amundi Asset Management únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto del Fondo.

La información detallada sobre la política de remuneración actualizada de la sociedad gestora puede consultarse en www.amundiETF.com o sin coste alguno previa solicitud por escrito a la sociedad gestora. Esta política describe, en particular, los métodos de cálculo de la remuneración y los beneficios de determinadas categorías de empleados, los organismos encargados de su asignación y la composición del Comité de remuneración.

El Fondo está autorizado en Luxemburgo y supervisado por la Comisión de Supervisión del Sector Financiero (Commission de Surveillance du Secteur Financier, CSSF). Amundi Asset Management está regulada por la Autoridad de los Mercados Financieros francesa (Autorité des Marchés Financiers, AMF).

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