

# WESENTLICHE INFORMATIONEN FÜR DEN ANLEGER

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

## Lyxor ESG EUR High Yield Bond (DR) UCITS ETF - Dist („Fonds“)

ISIN: LU1812090543 - Ein Teilfonds der Investmentgesellschaft Lyxor Index Fund (die „Gesellschaft“) mit Sitz in Luxemburg.

Verwaltet von Amundi Asset Management, einer Tochtergesellschaft der Amundi-Gruppe

### Anlageziele und -politik

Beim Fonds handelt es sich um einen Index nachbildenden OGAW mit passiver Verwaltung. Das Anlageziel des Fonds besteht darin, sowohl die Aufwärts- als auch die Abwärtsbewegung des auf Euro lautenden Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index („Benchmarkindex“) abzubilden. Gleichzeitig soll die Volatilität der Renditedifferenz zwischen Fonds und Benchmarkindex („Tracking Error“) so gering wie möglich gehalten werden. Das erwartete Niveau des Tracking Errors unter normalen Marktbedingungen wird im Prospekt angegeben.

Der Benchmarkindex stellt die Performance von auf Euro lautenden Hochzinsanleihen dar, die von Unternehmen in Industrieländern ausgegeben werden und Kriterien in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) entsprechen, basierend auf einem ESG-Rating. Die Methode zur Ermittlung des ESG-Ratings beruht auf wesentlichen ESG-Problemen wie unter anderem Wasserstress, Kohlenstoffemissionen, Betrieb und Geschäftsethik. Der Benchmarkindex verfolgt einen „Best-in-class“-Ansatz, mit dem das zulässige Universum um mindestens 20% verringert werden kann (ausgedrückt in Anzahl Emittenten). Die Grenzen der Methode des Benchmarkindex werden im Fondsprospekt mittels Risikofaktoren beschrieben.

Der Benchmarkindex ist ein Index des Typs „Total Return“ (Gesamtrenditeindex). Ein Gesamtertragsindex berechnet die Performance der Indexkomponenten auf der Grundlage, dass sämtliche Kupons oder Ausschüttungen in der Indexrendite inbegriffen sind. Weitere Informationen zum Benchmarkindex finden sich auf der folgenden Website: <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>

Der Fonds will sein Ziel über eine direkte Replikation erreichen, indem er hauptsächlich in im Benchmarkindex vertretene Wertpapiere investiert. Zur Optimierung der Replikation kann der Fonds eine Abbildungsstrategie einsetzen, die auf Stichproben beruht. Die potenzielle Nutzung dieser Technik ist auf der Website von Amundi unter [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com) veröffentlicht.

Die aktualisierte Zusammensetzung der Fondsbestände kann unter [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com) eingesehen werden.

Der unverbindliche Nettoinventarwert kann außerdem den Fondsseiten von Reuters und Bloomberg entnommen werden und gegebenenfalls auch auf den Websites der Handelsplätze, an denen der Fonds notiert wird, angegeben sein.

Die Anteilswährung ist der Euro (EUR).

- **Investierte Finanzinstrumente:** Internationale Anleihen, Derivative Finanzinstrumente.
- **Dividendenpolitik:** Die (etwaigen) ausschüttbaren Erträge des Fonds werden ausgeschüttet.
- **Nettoinventarwert:** wird täglich berechnet, insofern es sich um einen Geschäftstag an den Börsen handelt und die Anträge ausgeführt werden können.
- **Rücknahmen:** Die Anleger können ihre Anteile an jedem Bewertungstag bis 16:45 Uhr europäischer/luxemburgischer Zeit am Primärmarkt zurücknehmen lassen und ihre Anteile jederzeit während der Handelszeiten an dem Sekundärmarkt der Börsen, an denen der Fonds notiert ist, verkaufen.

### Risiko- und Ertragsprofil



Die oben dargestellte Risiko- und Ertragskategorie beruht auf der Wertentwicklung der im Fonds gehaltenen Anlagen in der Vergangenheit, der Wertentwicklung seiner Benchmark oder der berechneten Wertentwicklung eines Portfoliomodells. Diese Risikoeinschätzung stellt deswegen möglicherweise keinen verlässlichen Hinweis auf das zukünftige Risiko dar und kann sich im Laufe der Zeit verändern. Die niedrigste Kategorie kann nicht mit einer risikolosen Anlage gleichgesetzt werden.

Aufgrund seines Engagements im Benchmarkindex wurde der Fonds in die Kategorie 4 eingestuft. Kategorie 4 bedeutet, dass unter normalen Marktumständen ein mäßiger Kapitalverlust möglich ist; der Wert Ihrer Anlage kann sich mäßig ändern und geringen täglichen Auf- und Abwärtsschwankungen unterliegen.

Nicht durch den obigen Indikator erfasste wesentliche Risiken, die zu einem Rückgang des Nettoinventarwerts des Fonds führen könnten und die der Fonds in diesem Dokument offen legen darf (weitere Angaben zu den Risiken sind dem Abschnitt Risikoprofil im Prospekt zu entnehmen):

- **Kontrahentenrisiko:** Der Fonds ist dem Risiko ausgesetzt, dass eine Gegenpartei, mit der er eine Vereinbarung oder Transaktion geschlossen hat, insolvent werden oder sonst wie ausfallen könnte, und insbesondere, wenn er im Freiverkehr gehandelte derivative Finanzinstrumente oder Wertpapierleihen geschlossen hat. In einem solchen Fall kann der Nettoinventarwert des Fonds umfassend sinken. Laut den für den Fonds geltenden Vorschriften darf dieses Risiko höchstens 10 % des Gesamtvermögens des Fonds je Gegenpartei entsprechen.
- **Mit dem Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten verbundenes Risiko:** Der Fonds investiert in derivative Finanzinstrumente. Diese derivativen Finanzinstrumente können verschiedene Arten von Risiken bergen, wie (unter anderem) Hebelrisiko, Risiko hoher Volatilität, Bewertungsrisiko oder Liquiditätsrisiko. Wenn ein solches Risiko auftritt, kann der Nettoinventarwert des Fonds erheblich sinken.
- **Operationelles Risiko:** Im Falle einer Störung der betrieblichen Abläufe innerhalb der Verwaltungsgesellschaft oder bei einem ihrer Vertreter müssen die Anleger unter Umständen Verluste, Verzögerungen bei der Zeichnung, der Umwandlung, der Rücknahme oder sonstige Störungen hinnehmen.
- **Liquiditätsrisiko:** Unter gewissen Umständen, beispielsweise bei niedrigen Handelsvolumina an den Finanzmärkten, kann der Kauf oder Verkauf von vom Fonds gehaltenen Finanzinstrumenten, oder die sich auf seinen Wert auswirken, zu umfassenden Schwankungen ihrer Bewertungen führen. In solch einem Fall könnte der Nettoinventarwert des Fonds beeinträchtigt werden.
- **Kreditrisiko:** Der Fonds unterliegt dem Risiko, dass ein Emittent insolvent werden oder einem anderen Ereignis unterliegen könnte, das sich auf die Bonität dieses Emittenten auswirkt. Die Folgen dieses Risikos oder Ereignisses können zu einem Rückgang des Nettoinventarwerts des Fonds führen.

## Kosten für diesen Fonds

Die von Ihnen getragenen Kosten werden für die Funktionsweise des Fonds, einschließlich der Vermarktung und des Vertriebs, verwendet. Diese Kosten beschränken das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage. Weitere Informationen sind dem Kapitel Kosten im Fondsprospekt zu entnehmen, der unter [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com) erhältlich ist.

### Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

**Ausgabeaufschlag:** Gilt nicht für Anleger am Sekundärmarkt\*

**Rücknahmeabschlag:** Gilt nicht für Anleger am Sekundärmarkt\*

Dabei handelt es sich um den Höchstbetrag, der vor der Anlage und vor der Auszahlung Ihrer Rendite abgezogen wird.

\***Sekundärmarkt:** Da es sich bei dem Fonds um einen ETF handelt, können Anleger, die keine autorisierten Teilnehmer sind, Anteile grundsätzlich nur am Sekundärmarkt kaufen oder verkaufen. Dementsprechend zahlen Anleger Maklerprovisionen und/oder Transaktionskosten bei ihren Börsengeschäften. Bei diesen Maklerprovisionen und/oder Transaktionskosten erfolgt keine Erhebung durch bzw. Zahlung an den Fonds oder die Verwaltungsgesellschaft, sondern an den eigenen Vermittler des Anlegers. Außerdem müssen Anleger unter Umständen die Kosten von „Bid/Ask“-Spreads tragen; das ist die Differenz zwischen den Preisen, zu denen Anteile gekauft und verkauft werden können.

**Primärmarkt:** Autorisierte Teilnehmer, die direkt mit dem Fonds handeln, zahlen die zugehörigen Transaktionskosten am Primärmarkt.

Weitere Informationen sind den betreffenden Abschnitten im Fondsprospekt zu entnehmen.

### Kosten, die vom Fonds im Laufe des Jahres abgezogen werden.

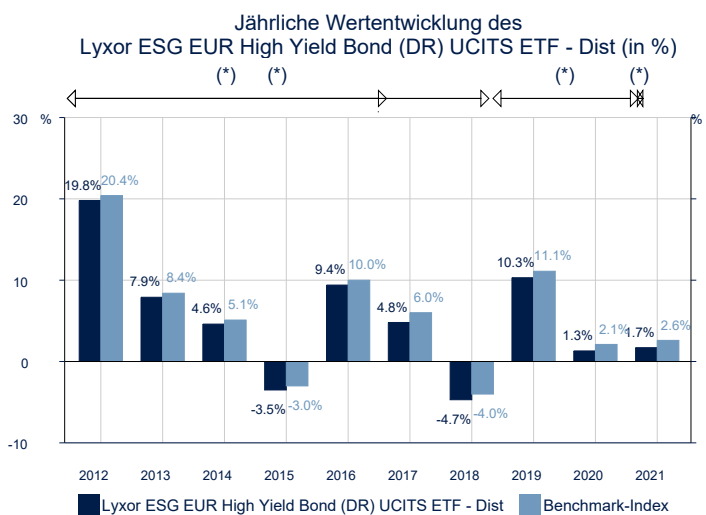
**Laufende Kosten:** 0,25 %.

Bei den an dieser Stelle ausgewiesenen laufenden Kosten handelt es sich um eine Kostenschätzung. In dieser Schätzung spiegelt sich die ab 26. Februar 2021 wirksame Verminderung der Verwaltungsgebühren wider. Die an dieser Stelle ausgewiesene Zahl entspricht dem Satz, der nach diesem Zeitpunkt anwendbar ist, und unterscheidet sich von den genauen Kosten, die während des gesamten Jahres einschließlich der Zeit vor der Änderung angefallen sind. Der OGAW-Jahresbericht für jedes Geschäftsjahr enthält nähere Einzelheiten zu den genauen berechneten Kosten. Nicht darin enthalten sind an die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren und Portfoliotransaktionskosten mit Ausnahme von Ausgabeauf-/Rücknahmeabschlägen, die vom Fonds beim An- oder Verkauf von Anteilen zugrunde liegender OGAW gezahlt werden.

### Kosten, die der Fonds unter bestimmten Umständen zu tragen hat

**An die Wertentwicklung gebundene Provisionen:** Nicht zutreffend.

## Performance der Vergangenheit



Wertentwicklungen in der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die künftige Wertentwicklung. Die Wertentwicklung wird in Euro (EUR) nach Abzug sämtlicher vom Fonds getragenen Gebühren angegeben. Der Fonds wurde am 25. Oktober 2018 aufgelegt.

Wenn der Benchmarkindex auf eine andere Währung als die Fondswährung lautet, wird die Wertentwicklung des Benchmarkindex zu Vergleichszwecken in die Fondswährung umgewandelt. Devisengeschäfte werden täglich ausgeführt (WM Reuters Kurs um 17 Uhr am entsprechenden Datum).

(\*) Bis zum 08.03.2017 galt der „Markt iBoxx EUR Liquid High Yield 30 Ex-Financial“ als Benchmarkindex für den Fonds.

(\*) Bis zum 25.10.2018 entsprechen die erzielten Wertentwicklungen des angegebenen Fonds den Wertentwicklungen der Teilfonds des MULTI UNITS FRANCE - Lyxor BofAML € High Yield Ex-Financial Bond UCITS ETF (der aufgenommene Fonds). Dieser Fonds wurde am 25.10.2018 vom Fonds aufgenommen.

(\*) Bis zum 15.03.2021 entsprechen die hierin dargelegten Wertentwicklungen des Fonds einer indirekten Nachbildung des Benchmarkindex. Ab dem 16.03.2021 entsprechen die hierin dargelegten Wertentwicklungen des Fonds einer direkten Nachbildung des Benchmarkindex.

(\*) Bis zum 10.03.2021 galt der BofA Merrill Lynch BB-CCC Euro Developed Markets Non-Financial High Yield Constr Index als Benchmarkindex für den Fonds.

## Nützliche Informationen

### Verwahrstelle: Société Générale Luxembourg.

Weitere nützliche Informationen über den Fonds, den letzten Prospekt sowie die letzten Jahres- und Halbjahresberichte können in französischer oder englischer Sprache kostenlos beim Kundendienst der Verwaltungsgesellschaft, 91-93, boulevard Pasteur, 75015 Paris, Frankreich, erfragt werden. Der Fonds ist ein Teilfonds des Lyxor Index Fund der Gesellschaft. Der Prospekt sowie die letzten Jahres- und Halbjahresberichte werden für die gesamte Gesellschaft erstellt.

Die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten jedes Teilfonds der Gesellschaft sind rechtlich voneinander getrennt (d. h. Vermögenswerte des Fonds können nicht zur Zahlung von Verbindlichkeiten anderer Teilfonds der Gesellschaft verwendet werden). Sofern zutreffend, werden die Vorschriften für die Umwandlung zwischen Teilfonds im Prospekt der Gesellschaft dargelegt.

### Weitere Informationen: Der Nettoinventarwert sowie (gegebenenfalls) Informationen über andere Anteilsklassen sind erhältlich unter [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com).

Informationen zu Markt Makern, Börsen und sonstige Handelsinformationen finden sich auf der für den Fonds vorgesehenen Seite auf der Website [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com). Die Börse veröffentlicht den unverbindlichen Nettoinventarwert während der Handelszeiten in Echtzeit.

### Steuern: Die im Mitgliedstaat des Fonds, wo er seinen Sitz hat, geltenden Steuervorschriften können sich auf die Anleger auswirken. Für weitere Informationen richten Sie sich bitte an Ihren gewöhnlichen Steuerberater.

Amundi Asset Management kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Fondsprospekts vereinbar ist.

Einzelheiten zur aktualisierten Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft finden sich unter [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com) oder können kostenlos auf schriftliche Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft erhalten werden. Diese Politik beschreibt insbesondere die Berechnungsmethoden für die Vergütung und Zuwendungen gewisser Arbeitnehmerkategorien, die für ihre Zuteilung zuständigen Gremien und die Zusammensetzung des Vergütungsausschusses.

Der Fonds ist in Luxemburg zugelassen und unterliegt der Aufsicht der Commission de surveillance du secteur financier. Amundi Asset Management wird durch die Autorité des marchés financiers reguliert.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 1. Juni 2022.