

WESENTLICHE INFORMATIONEN FÜR DEN ANLEGER

Die französische Version dieses Dokuments, die von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) freigegebene offizielle Schweizer Version, hat unter allen Umständen Vorrang gegenüber dieser einfachen deutschen Übersetzung. Diese als gewerbliches Dokument angesehene deutsche Übersetzung muss dem Anleger unbedingt zusammen mit der entsprechenden französischen offiziellen Schweizer Version übergeben werden. Die darin enthaltenen Informationen werden bereitgestellt, damit Sie sich umfassend über die Art dieser Anlage und die mit einer Anlage in diesen Fonds verbundenen Risiken informieren können. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

Lyxor Smart Overnight Return - UCITS ETF D-EUR („Fonds“)

ISIN: LU2082999306 - Ein Teilfonds der Investmentgesellschaft Lyxor Index Fund (die „Gesellschaft“) mit Sitz in Luxemburg.

Verwaltet von Lyxor International Asset Management S.A.S. („LIAM“)

Anlageziele und -politik

Beim Fonds handelt es sich um einen OGAW mit aktiver Verwaltung.

Das Anlageziel des Fonds besteht darin, eine an Geldmarktzinsen angebundene Rendite zu erzielen.

Der Benchmark des Fonds ist der durchschnittliche EONIA-Satz („Benchmarkindex“). Der Fonds wird aktiv verwaltet und investiert innerhalb eines strengen Risiko- und Liquiditätskontrollrahmens in ein diversifiziertes Portfolio von Finanzinstrumenten. Der Großteil der Anlagen oder Engagements des Fonds sind an den Benchmarkindex gebunden. Die Anlagestrategie des Fonds ist an den Benchmarkindex gebunden, jegliche Abweichung vom Benchmarkindex ist begrenzt.

Der EONIA-Satz (Euro OverNight Index Average) ist ein effektiver Tagesgeldsatz, der als gewichteter Durchschnitt aller unbesicherten Übernachtkontrakte am Interbankenmarkt in Euro berechnet wird.

EONIA-Referenzzinssätze werden von der Europäischen Zentralbank auf Grundlage aller Interbanken-Übernachtvermögen berechnet, die vor der Schließung der RTGS-Systeme um 18:00 Uhr MEZ geschaffen und von Thomson Reuters jeden Tag bis 19:00 Uhr MEZ veröffentlicht werden.

Der EONIA-Tagessatz beinhaltet die Auswirkung der Wiederanlage der erhaltenen Zinsen nach der OIS-Methode (Overnight Indexed Swap).

Für den Teilfonds gilt weder von einer Swap-Gegenpartei (Société Générale) noch von einem Unternehmen, das als Vertriebsstelle des Teilfonds fungiert, eine implizierte oder explizite Garantie.

Der EONIA-Referenzzinssatz kann negativ sein, was zu einer negativen Wertentwicklung des Fonds führen könnte.

Die aktualisierte Zusammensetzung der Fondsbestände kann unter www.lyxoretf.com eingesehen werden.

Der unverbindliche Nettoinventarwert kann ebenfalls den Fondsseiten von Reuters und Bloomberg entnommen werden und ebenfalls auf den Websites der Handelsplätze, an denen der Fonds gehandelt wird, angegeben werden.

Die Anteilswährung ist der Euro (EUR).

- **Investierte Finanzinstrumente:** Um sein Anlageziel zu erreichen, besteht das Anlageuniversum des Teilfonds aus: Geldmarktinstrumenten einschließlich Bareinlagen bei Kreditinstituten, – übertragbaren Wertpapieren (einschließlich Aktien, Schuldinstrumenten mit festem oder variablem Kupon) oder Anteilen an OGAW, die gemäß der OGAW-Richtlinie zugelassen sind, – derivativen Finanzinstrumenten, insbesondere einschließlich: Geldmarkt-Swaps, Devisenterminkontrakten und Devisen-Swappgeschäften, die streng zur Absicherung von Währungsrisiken bestimmt sind, und Zins-Swappgeschäften, die auf die Reduzierung von Zinsrisiken abzielen.
- effizienten Portfoliomanagementmethoden einschließlich Wertpapierleihe, Pensions- und umgekehrten Pensionsgeschäften mit übertragbaren Wertpapieren (einschließlich Aktien, fest- oder variabelverzinslichen Schuldinstrumenten).
Der Teilfonds kann auch Barmittel halten.
- **Dividendenpolitik:** Die (etwaigen) ausschüttbaren Erträge des Fonds werden ausgeschüttet.
- **Nettoinventarwert:** Der Nettoinventarwert je Anteil wird an jedem Bewertungstag berechnet.
- **Rücknahmen:** Die Anleger können ihre Anteile an jedem Bewertungstag vor 13:00 Uhr europäische/luxemburgische Zeit auf dem Primärmarkt zurücknehmen lassen und ihre Anteile jederzeit während der Handelszeiten an den 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 2 eingestuft. Kategorie 2 bedeutet, dass ein Kapitalverlust unter normalen Marktumständen möglich, aber sehr unwahrscheinlich ist.

INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER SCHWEIZ

▪ Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz

Société Générale, Paris, Niederlassung Zürich, Talacker 50, Postfach 5070, 8021 Zürich, nimmt die Funktionen des Vertreters in der Schweiz wahr. Société Générale, Paris, Niederlassung Zürich, nimmt ausserdem die Funktion der Zahlstelle für den Fonds in der Schweiz wahr.

▪ Vertriebsort der wesentlichen Dokumente

Der Prospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung bzw. der Gesellschaftsvertrag des Fonds sowie die Jahres- und Halbjahresberichte des Fonds können auf einfache Anfrage und kostenlos vom Sitz des Vertreters in der Schweiz bezogen werden.

▪ Veröffentlichungen

In der Schweiz erfolgen Veröffentlichungen oder Mitteilungen des Fonds auf der elektronischen Plattform www.fundinfo.com. Der Nettoinventarwert je Anteil mit dem Vermerk „ohne Provisionen“ wird an jedem Geschäftstag auf der elektronischen Plattform www.fundinfo.com veröffentlicht.

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.
- **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.lyxoretf.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: | 0,05 %. |
|-------------------------|---------|

Der hier genannte Satz für die laufenden Kosten stellt eine Schätzung des Prozentwerts der Kosten (einschließlich etwaiger Steuern) dar, die dem Fonds in laufenden Jahr möglicherweise entstehen werden. 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: | N.z. |
|--|------|

Performance der Vergangenheit

Jährliche Wertentwicklung des
Lyxor Smart Overnight Return - UCITS ETF D-EUR (in %)

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 17. September 2020 aufgelegt.

- Es gibt nicht ausreichend Daten, um den Anlegern einen sachdienlichen Hinweis auf die vergangene Performance des Fonds zu geben -

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, 17, Cours Valmy, Tour Société Générale 92800 Puteaux, 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 Anteilklassen sind erhältlich unter www.lyxoretf.com.

Informationen zu Market Makern, Börsen und sonstige Handelsinformationen finden sich auf der für den Fonds vorgesehenen Seite auf der Website www.lyxoretf.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.
- **ESG:** Kriterien in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) sind einer der Bestandteile der Anlageentscheidungen, wobei diese keinen wesentlichen Faktor für die Verwaltung darstellen, insbesondere in Bezug auf die Umsetzung der Anlagestrategie.

Lyxor International 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.lyxor.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. Lyxor International Asset Management wird durch die Autorité des marchés financiers reguliert.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 15. März 2021.