

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 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 Amundi Asset Management, einer Tochtergesellschaft der Amundi-Gruppe

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. Die Benchmark des Fonds ist der durchschnittliche €STR-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 €STR (Euro Short-Term Rate) stellt die für den Handel mit auf Euro lautenden unbesicherten Übernachtskrediten von Banken angefallenen Kosten im Euroraum dar. Der €STR verwendet die Transaktionsdaten aus den täglichen Devisenberichten der 52 größten Banken im Euroraum. Hierbei handelt es sich um den durchschnittlichen Zinssatz auf Darlehen im Laufe des Tags.

Der tägliche durchschnittliche €STR wird von der EZB berechnet und veröffentlicht. Der €STR wird an jedem Werktag basierend auf am vorherigen Werktag (dem Berichtsdatum „T“) mit einem Fälligkeitsdatum von T+1 durchgeführten und abgewickelten Transaktionen, deren Ausführung zu marktüblichen Bedingungen gilt und somit die Marktsätze unverzerrt darstellt, veröffentlicht.

Für den Fonds gilt weder von einer Swap-Gegenpartei noch von einem Unternehmen, das als Vertriebsstelle des Fonds fungiert, eine implizite oder explizite Garantie.

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

Die aktualisierte Zusammensetzung der Fondsbestände kann unter www.amundiETF.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 1 eingestuft. Kategorie 1 bedeutet, dass ein Kapitalverlust unter normalen Marktumständen möglich, aber extrem unwahrscheinlich ist.

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

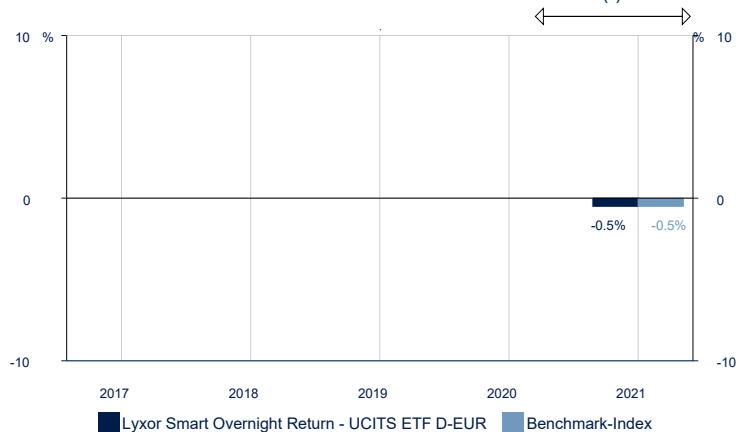
Die Angaben für die laufenden Kosten (einschließlich etwaiger Steuern) stützen sich für das im Oktober 2021 endende Jahr auf die Vorjahreswerte und können von Jahr zu Jahr schwanken. Nicht darin enthalten sind an die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren und Portfoliotransaktionskosten mit Ausnahme 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.

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).

(*) Vom 17. September 2020 bis zum 31. Dezember 2021 war der zum Vergleich der Wertentwicklung verwendete Benchmarkindex der EONIA-Zinssatz. Seit dem 01. Januar 2022 ist der €STR-Zinssatz der Benchmarkindex.

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 Anteilklassen sind erhältlich unter www.amundiETF.com.

Informationen zu Market Makern, Börsen und sonstige Handelsinformationen finden sich auf der für den Fonds vorgesehenen Seite auf der Website 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 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.