DOCUMENTO DE DATOS FUNDAMENTALES

Finalidad: *Este documento le proporciona información fundamental que debe conocer sobre este producto de inversión. No se trata de material comercial.*
Es una información exigida por ley para ayudarle a comprender la naturaleza, los riesgos, los costes y los beneficios y pérdidas potenciales de este producto y para ayudarle a compararlo con otros productos.

Producto

Lyxor Global High Yield Sustainable Exposure UCITS ETF - Monthly Hedged to EUR - Acc

Un Subfondo de Lyxor Index Fund

LU2099296274 - Moneda: EUR

Este Subfondo está autorizado en Luxemburgo.
Sociedad de gestión: Amundi Asset Management (en lo sucesivo, "nosotros"), miembro del grupo de empresas Amundi, está autorizada en Francia y regulada por la Autorité des marchés financiers.
La AMF es responsable de la supervisión de Amundi Asset Management en relación con este documento de datos fundamentales.
Para obtener más información, consulte www.amundi.fr o llame al +33 143 23 30 30.

Este documento se publicó el 22/08/2023.

DOCUMENTO DE DATOS FUNDAMENTALES

¿Qué es este producto?

Tipo: Acciones de un Subfondo de Lyxor Index Fund, un organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM), establecido como SICAV.

Plazo: El plazo de este Subfondo es ilimitado. La sociedad de gestión podrá poner fin al Fondo mediante la liquidación o la fusión con otro fondo de conformidad con los requisitos legales.

Objetivos: El Fondo es un OICVM de gestión pasiva que replica un Índice de referencia.
El objetivo de inversión del Fondo es seguir la evolución, tanto al alza como a la baja, del Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index (en lo sucesivo, el "**Índice de referencia**") denominado en dólares estadounidenses (USD), minimizando al mismo tiempo la diferencia entre el rendimiento del Fondo y el del Índice de referencia (en lo sucesivo, el "**Error de seguimiento**").
El nivel previsto de Error de seguimiento en condiciones de mercado normales se indica en el folleto.
El Índice de referencia es representativo de la rentabilidad de los bonos corporativos de alto rendimiento denominados en USD, EUR y GBP, emitidos por entidades que cumplen los criterios medioambientales, sociales y de gobernanza ("**ESG**"), sobre la base de una calificación ESG. La metodología de calificación ESG se basa en aspectos clave ESG, que incluyen, sin carácter restrictivo, el estrés hídrico, las emisiones de carbono, la gestión laboral y la ética empresarial.
El Índice de referencia utiliza un enfoque "mejor en su clase", que permite la reducción de al menos el 20 % del universo apto (expresado en número de emisores). Los límites de la metodología del Índice se describen en el folleto del Fondo a través de los factores de riesgo, como el riesgo de mercado vinculado a las controversias y los riesgos vinculados a las metodologías ESG y al cálculo de la puntuación ESG.
Para cubrir el riesgo de cambio del USD, el Fondo utiliza una estrategia de cobertura mensual cuyo objetivo es reducir el impacto de un cambio en la moneda del Fondo frente a la moneda de los componentes del Índice de referencia.
Puede encontrar más información sobre el Índice de referencia en https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/.
El Índice de referencia es un índice de rendimiento total. Un índice de rendimiento total calcula la rentabilidad de los componentes del Índice a partir del principio de que cualquier dividendo o distribución se incluye en los rendimientos del Índice.

El Fondo tratará de alcanzar su objetivo a través de la réplica indirecta mediante la celebración de un contrato de permuta financiera extrabursátil (instrumento financiero derivado, "IFD") El Fondo también podrá invertir en una cartera diversificada de valores de deuda, cuya rentabilidad se permutará por la del Índice de referencia por medio de IFD. Además de cumplir con los criterios de elegibilidad de valores descritos en el folleto, la cesta de valores mantenida por el Fondo también cumplirá otras restricciones, de modo que los activos del Fondo se ajusten a las normas ESG del Índice de referencia. Para obtener más información sobre estas limitaciones adicionales, consulte la sección Política de inversión del folleto del Fondo.
Puede consultar la composición actualizada de las participaciones del Fondo en la web www.lyxoretf.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.

Inversor minorista al que va dirigido: Este producto está destinado a inversores con un conocimiento básico y poca o ninguna experiencia en inversiones en fondos, que busquen aumentar el valor de su inversión durante el período de mantenimiento recomendado y que estén dispuestos a asumir un nivel de riesgo alto respecto a su capital original.

Reembolso y negociación: Las acciones del Subfondo cotizan y se negocian en una o más bolsas de valores. En circunstancias normales, puede negociar con acciones durante el horario de negociación de las bolsas. Solo los participantes autorizados (por ejemplo, determinadas entidades financieras) pueden negociar acciones directamente con el Subfondo en el mercado primario. Puede encontrar más información en el folleto de Lyxor Index Fund.

Política de distribución: Debido a que se trata de una clase de acciones que no es de distribución, los ingresos de las inversiones se reinvierten. La acción de acumulación retiene y reinvierte automáticamente todos los ingresos atribuibles dentro del Subfondo, acumulando de este modo el valor en el precio de las acciones de acumulación.

Más información: Puede obtener más información sobre el Subfondo y solicitar el folleto y los informes financieros, que están disponibles de forma gratuita previa petición a través de: Amundi Asset Management, 91-93 boulevard Pasteur, 75015 París, Francia.
El valor liquidativo del Subfondo está disponible en www.mundi.lu.

Depositario: Société Générale Luxembourg.

¿Qué riesgos corro y qué podría obtener a cambio?

INDICADOR DE RIESGO

Riesgo más bajo — Riesgo más alto

El indicador de riesgo presupone que usted mantendrá el producto durante 3 años.

El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo 3 en una escala de 7, en la que 3 significa un riesgo medio bajo. Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como media baja y la probabilidad de que una mala coyuntura de mercado influya en nuestra capacidad de pagarle como improbable.

Riesgos adicionales: El riesgo de liquidez del mercado podría amplificar la variación de la rentabilidad entre los productos.

Este producto no incluye protección alguna contra la evolución futura del mercado, por lo que podría perder una parte o la totalidad de su inversión.

Además de los riesgos incluidos en el indicador de riesgo, otros riesgos pueden afectar a la rentabilidad del Subfondo. Consulte el folleto de Lyxor Index Fund.

ESCENARIOS DE RENTABILIDAD

Los escenarios desfavorable, moderado y favorable que se muestran son ilustraciones basadas en la rentabilidad más baja, media y más alta del Subfondo durante los últimos 10 años. Los mercados podrían evolucionar de manera muy distinta en el futuro. El escenario de tensión muestra lo que usted podría recibir en circunstancias extremas de los mercados.

Lo que obtenga de este producto dependerá de la evolución futura del mercado, la cual es incierta y no puede predecirse con exactitud.

Período de mantenimiento recomendado: 3 años
Inversión de 10.000 EUR

Escenarios		En caso de salida después de 1 año	En caso de salida después de 3 años
Mínimo	No hay un rendimiento mínimo garantizado. Podría perder parte o la totalidad de su inversión.		
Escenario de tensión	**Lo que podría recibir tras deducir los costes**	4.820 €	7.070 €
	Rendimiento medio cada año	-51,8 %	-10,9 %
Escenario desfavorable	**Lo que podría recibir tras deducir los costes**	7.500 €	8.060 €
	Rendimiento medio cada año	-25,0 %	-6,9 %
Escenario moderado	**Lo que podría recibir tras deducir los costes**	9.220 €	9.690 €
	Rendimiento medio cada año	-7,8 %	-1,0 %
Escenario favorable	**Lo que podría recibir tras deducir los costes**	10.620 €	10.630 €
	Rendimiento medio cada año	6,2 %	2,1 %

Las cifras presentadas incluyen todos los costes del producto propiamente dicho, pero es posible que no incluyan todos los costes que usted deba pagar a su asesor o distribuidor. Las cifras no tienen en cuenta su situación fiscal personal, que también puede influir en la cantidad que reciba.

Este tipo de escenario se produjo para una inversión que utilizaba un valor sustitutivo adecuado.

Escenario favorable: Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre el 31/12/2018 y el 31/12/2021.
Escenario moderado: Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre el 31/08/2016 y el 30/08/2019
Escenario desfavorable: Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre el 31/08/2021 y el 10/08/2023.

¿Qué pasa si Amundi Asset Management no puede pagar?

Para cada Subfondo de Lyxor Index Fund, se invierte y mantiene un conjunto separado de activos. Los activos y los pasivos del Subfondo están segregados de los de otros subfondos, así como de los de la sociedad de gestión, y no existe responsabilidad cruzada entre ellos. El Subfondo no será responsable si la sociedad de gestión o un proveedor de servicios delegado incurriera en impago.

¿Cuáles son los costes?

La persona que le asesore sobre este producto o se lo venda puede cobrarle otros costes. En tal caso, esa persona le facilitará información acerca de estos costes y de la incidencia que tienen en su inversión.
Los cuadros muestran los importes que se detraen de su inversión para cubrir diferentes tipos de costes. Estos importes dependen de cuánto invierte y de cuánto tiempo mantiene el producto Los importes indicados aquí ilustran un ejemplo de inversión de una determinada cuantía durante diferentes períodos de inversión posibles.
Hemos partido de los siguientes supuestos:
— El primer año, recuperaría usted el importe invertido (rendimiento anual del 0 %). En relación con los demás períodos de mantenimiento, hemos supuesto que el producto evoluciona tal como muestra el escenario moderado.
— Se invierten 10.000 EUR.

COSTES A LO LARGO DEL TIEMPO

Inversión de 10.000 EUR		
Escenarios	**En caso de salida después de**	
	1 año	**3 años***
Costes totales	30 €	87 €
Incidencia anual de los costes**	0,3 %	0,3 %

* Período de mantenimiento recomendado.
** Refleja la medida en que los costes reducen su rendimiento cada año a lo largo del período de mantenimiento. Por ejemplo, muestra que, en caso de salida al término del período de mantenimiento recomendado, el rendimiento medio que se prevé que obtendrá cada año será del -0,75 % antes de deducir los costes y del -1,04 % después de deducir los costes.
No cobramos comisión de entrada

Si invierte en este producto en el marco de un contrato de seguros, los costes indicados no incluyen los costes adicionales que podría soportar.

COMPOSICIÓN DE LOS COSTES

Costes únicos de entrada o salida		En caso de salida después de 1 año
Costes de entrada*	No cobramos comisión de entrada para este producto.	0 EUR
Costes de salida*	No cobramos una comisión de salida por este producto, pero es posible que la persona que se lo venda sí lo haga.	0 EUR
Costes corrientes detraídos cada año		
Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento	El 0,30 % del valor de su inversión al año. Este porcentaje se basa en los costes reales del último año.	30,00 EUR
Costes de operación	No cobramos comisión de operación por este producto.	0,00 EUR
Costes accesorios detraídos en condiciones específicas		
Comisiones de rendimiento	No se aplica ninguna comisión de rendimiento a este producto.	0,00 EUR

* Mercado secundario: Dado que el Fondo es un fondo cotizado (ETF), los inversores que no sean participantes autorizados generalmente solo podrán comprar o vender acciones en el mercado secundario. En consecuencia, los inversores pagarán comisiones de intermediación o costes de operación en relación con sus negociaciones en las bolsas de valores. Estas comisiones de intermediación o costes de operación no son cobrados ni pagaderos al Fondo ni a la sociedad de gestión, sino al intermediario propio del inversor. Además, los inversores también pueden asumir los costes de los diferenciales entre precios comprador y vendedor, es decir, la diferencia entre los precios a los que se pueden comprar y vender las acciones.
Mercado principal: Los participantes autorizados que negocien directamente con el Fondo pagarán los costes de operación relacionados con el mercado principal, tal y como se detalla en el folleto.

¿Cuánto tiempo debo mantener la inversión, y puedo retirar dinero de manera anticipada?

Período de mantenimiento recomendado: 3 años. Se determina a partir de nuestra evaluación de las características de riesgo y recompensa y los costes del Subfondo.

Este producto está diseñado para inversiones a medio plazo; debe estar dispuesto a mantener su inversión durante al menos 3 años. Usted podrá reembolsar su inversión en cualquier momento o mantenerla durante más tiempo.

Calendario para órdenes: Las órdenes de reembolso de acciones deben recibirse antes de las 17:00, hora de Luxemburgo, del Día de Valoración. Consulte el Folleto de Lyxor Index Fund para obtener más información sobre los reembolsos.

¿Cómo puedo reclamar?

Para presentar sus reclamaciones puede:
- Enviar su reclamación por correo postal a Amundi Asset Management, 91-93 boulevard Pasteur, 75015 París, Francia
- Enviar un correo electrónico a complaints@amundi.com

En caso de reclamación, debe indicar claramente sus datos de contacto (nombre, dirección, número de teléfono o dirección de correo electrónico) y explicar brevemente en qué consiste. Puede obtener más información en nuestra página web: www.amundi.fr.
Si tiene alguna queja sobre la persona que le informó de este producto o se lo vendió, dicha persona le comunicará dónde debe presentar la reclamación.

Otros datos de interés

Puede encontrar el folleto, los estatutos, los documentos de datos fundamentales para el inversor, las notificaciones a los inversores, los informes financieros y otros documentos informativos relacionados con el Subfondo, incluidas varias políticas publicadas del Subfondo, en nuestro sitio web: www.amundi.fr. También puede solicitar una copia de dichos documentos en el domicilio social de la sociedad de gestión.

Rentabilidad histórica: Puede descargar la rentabilidad histórica del Subfondo de los últimos 5 años en www.amundi.fr.

Escenarios de rentabilidad: Puede encontrar los escenarios de rentabilidad anterior actualizados mensualmente en www.amundi.fr.