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 MSCI World Catholic Principles ESG (DR) UCITS ETF - Acc

Un Subfondo de Lyxor Index Fund

LU2216829809 - Moneda: USD

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 objetivo de inversión del Fondo es seguir tanto la evolución, tanto al alza como a la baja, del MSCI World Select Catholic Principles ESG Universal and Environment Net Total Return Index (en lo sucesivo, el "Índice de referencia") denominado en dólares estadounidenses (USD), minimizando al mismo tiempo la volatilidad de la diferencia entre la rentabilidad del Fondo y la 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 un índice bursátil calculado y publicado por el proveedor de índices internacionales MSCI, que presenta las siguientes características:
1) Mismo universo de inversión de valores que el Índice MSCI World (el "Índice principal");
2) Exclusión de empresas con una Calificación MSCI ESG estrictamente inferior a "BB", involucradas en negocios controvertidos, y con una controversia ESG muy grave;
3) Exclusión de empresas que están involucradas en investigación con células madre, abortos y anticonceptivos, y el bienestar animal;
4) Exclusión del 20 % de los valores con mayor intensidad de emisiones de carbono y reducción de las emisiones potenciales de carbono de las reservas de combustibles fósiles en un 50 %;
5) Ponderación por el producto de las ponderaciones de la capitalización bursátil free float de las empresas del Índice principal y una puntuación ESG combinada que refleja una evaluación tanto del perfil ESG actual como de la tendencia de dicho perfil.
El folleto describe las limitaciones de la metodología del Índice de referencia a través de factores de riesgo como el riesgo relacionado con los datos sobre el carbono utilizados en la metodología del Índice de referencia o la falta de reactividad a las circunstancias cambiantes de los fundamentales ESG, o los riesgos extrafinancieros relacionados con los componentes del Índice de referencia.
El sitio web de MSCI (https://us.spindices.com/) contiene información más detallada sobre los índices MSCI.
El Índice de referencia es un índice de rendimiento total neto. Un índice de rendimiento total neto 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 después de deducir los impuestos.
El Fondo tratará de alcanzar su objetivo a través de una réplica directa, invirtiendo principalmente en los valores que componen el Índice de referencia. Para optimizar la réplica del Índice de referencia, el Fondo podrá utilizar una estrategia de réplica por muestreo. El posible uso de esta técnica se publica en el sitio web de Lyxor: www.lyxoretf.com.
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, 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 5 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 4 en una escala de 7, en la que 4 significa un riesgo medio. Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como media y la probabilidad de que una mala coyuntura de mercado influya en nuestra capacidad de pagarle como posible.

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: 5 años
Inversión de 10.000 USD

Escenarios		En caso de salida después de 1 año	En caso de salida después de 5 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**	5.030 $	3.440 $
	Rendimiento medio cada año	-49,7 %	-19,2 %
Escenario desfavorable	**Lo que podría recibir tras deducir los costes**	7.420 $	9.080 $
	Rendimiento medio cada año	-25,8 %	-1,9 %
Escenario moderado	**Lo que podría recibir tras deducir los costes**	10.670 $	14.370 $
	Rendimiento medio cada año	6,7 %	7,5 %
Escenario favorable	**Lo que podría recibir tras deducir los costes**	15.510 $	20.690 $
	Rendimiento medio cada año	55,1 %	15,7 %

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 31/10/2016 y el 29/10/2021.
Escenario moderado: Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre el 31/10/2014 y el 31/10/2019
Escenario desfavorable: Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre el 31/12/2021 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 USD.

COSTES A LO LARGO DEL TIEMPO

Inversión de 10.000 USD		
Escenarios	**En caso de salida después de**	
	1 año	**5 años***
Costes totales	32 $	229 $
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 7,86 % antes de deducir los costes y del 7,52 % 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 USD
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 USD
	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 USD
Costes de operación	El 0,02 % del valor de su inversión al año. Se trata de una estimación de los costes derivados de la compra y la venta de las inversiones subyacentes del producto. El importe real depende de la cantidad que compremos y vendamos.	1,70 USD
	Costes accesorios detraídos en condiciones específicas	
Comisiones de rendimiento	No se aplica ninguna comisión de rendimiento a este producto.	0,00 USD

* 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: 5 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 5 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 18:30, hora de Luxemburgo, a más tardar un (1) Día Hábil antes 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.