

Tämä asiakirja antaa sijoittajalle avaintiedot rahastosta. Se ei ole markkinointiaineistoa. Avaintiedot on annettava lakisääteisesti, jotta sijoittaja ymmärtäisi rahaston luonteen ja siihen liittyvät sijoitusriskit. Asiakirjaan tutustumista suositellaan, jotta sijoittaja voisi tehdä sijoituspäätöksensä tietoon perustuen.

Lyxor ESG EUR High Yield Bond (DR) UCITS ETF - Dist ("rahasto")

ISIN: LU1812090543 – Luxemburgissa rekisteröidyn Lyxor Index Fund -sijoitusyhtiön ("yhtiö") alarahasto.

Rahastoa hallinnoi Amundi Asset Management, Amundi-konsernin tytäryhtiö

Tavoitteet ja sijoituspolitiikka

Rahasto on passiivisesti hoidettu indeksiä seuraava yhteissijoitusyritys. Rahaston tavoitteena on seurata euromääräistä Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index -indeksiä ("vertailuindeksi"). Rahaston tuoton ja vertailuindeksin tuoton välisen eron volatiliiteetti ("seurantavirhe") pyritään minimoimaan. Seurantavirheen oletettu taso normaaleissa markkinaolosuhteissa on ilmoitettu rahastoesitteessä.

Vertailuindeksi edustaa sellaisten euromääräisten korkeatuottoisten joukkovelkakirjojen kehitystä, joiden liikkeeseenlaskijoina on kehittyneillä markkinoilla toimivia ympäristöön, yhteiskuntavastuuseen ja hyvään hallintotapaan (ESG) liittyvät kriteerit täyttäviä yhtiöitä. Yhtiöiden kelpoisuus määritetään niiden ESG-arvosanan perusteella. ESG-arvosana määräytyy ESG:n keskeisten näkökohtien perusteella, joita ovat muun muassa vesistressi, hiilidioksidipäästöt, työvoiman hallinta ja liiketoiminnan eettisyys. Vertailuindeksi käyttää "best-in-class" -lähestymistapaa, jossa indeksiin hyväksytyjen liikkeeseenlaskijoiden määrää voidaan vähentää vähintään 20 prosentilla. Vertailuindeksin menetelmän rajoitukset kuvataan rahaston rahastoesitteen riskitekijäosiossa.

Vertailuindeksi on kokonaistuottoindeksi. Kokonaistuottoindeksissä indeksin osatekijöiden tuotto lasketaan sillä perusteella, että mahdolliset kupongit ja voitonjaot sisällytetään indeksin tuottoon. Lisätietoa vertailuindeksistä on saatavilla seuraavalta verkkosivustolta: <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/>

Rahasto pyrkii saavuttamaan tavoitteensa suoralla replikoinnilla sijoittamalla pääasiassa vertailuindeksin sisältämiin arvopapereihin. Vertailuindeksin optimaalisen replikoinnin varmistamiseksi rahasto voi valita osakkeita otantaperusteisesti. Tämän tekniikan mahdollisesta käytöstä ilmoitetaan Amundin verkkosivuilla: www.amundietf.com.

Rahaston salkun koostumus on nähtävissä sivustolla www.amundietf.com.

Lisäksi viitteellinen nettoarvo julkaistaan Reutersin ja Bloombergin rahastoa koskevilla sivuilla ja mahdollisesti myös niiden pörssien verkkosivuilla, joihin rahasto on listattu.

Osuuden valuuttayksikkö on euro (EUR).

- **Sijoituskohteina olevat rahoitusinstrumentit:** kansainväliset joukkovelkakirjat, johdannaisinstrumentit.
- **Osingonjakoperiaatteet:** rahaston (mahdolliset) osingonjakoon käytettävissä olevat varat jaetaan sijoittajille.
- **Substanssiarvo:** lasketaan päivittäin sillä edellytyksellä, että asianomaiset pörssit ovat avoinna kaupankäyntiä varten, ja toimeksiannot voidaan toteuttaa.
- **Lunastukset:** sijoittajat voivat lunastaa osuutensa ensimarkkinoilla jokaisena arvotuspäivänä ennen klo 16.45 Keski-Euroopan aikaa ja myydä osuutensa jälkimarkkinoilla milloin tahansa rahaston noteerauspaikkojen kaupankäyntiaikana.

Riski-hyötyprofiili



Yllä esitetty riski-tuottoluokka perustuu rahaston varojen tai sen vertailuindeksin aiempaan tuottoon tai salkkumallin laskettuun tuottoon. Tämän riskiarvion perusteella ei siksi ehkä voida muodostaa luotettavia oletuksia tulevasta riskistä, ja luokitus voi vaihdella ajan myötä. Alhaisintaan riskiluokka ei merkitse riskitöntä sijoitusta.

Vertailuindeksille altistumisesta johtuen rahasto on sijoitettu luokkaan 4. Luokka 4 tarkoittaa, että normaaleissa markkinaolosuhteissa kohtuulliset pääoman menetykset ovat mahdollisia, ja sijoituksen arvo voi vaihdella päivittäin kohtuullisesti ja hitaasti ylös- tai alaspäin.

Tärkeimmät riskit, joita indikaattori ei ota huomioon mutta jotka saattavat vaikuttaa kielteisesti rahaston substanssiarvoon ja jotka rahasto ilmoittaa tässä asiakirjassa (lisätietoja riskeistä on rahastoesitteen riskiprofiliosiossa):

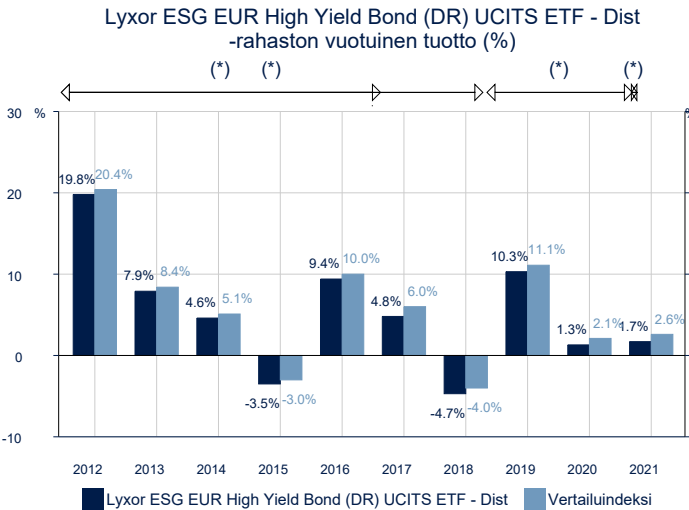
- **Vastapuoliriski:** Rahastoon kohdistuu riski siitä, että vastapuoli, jonka kanssa rahasto on tehnyt sopimuksen tai suorittanut transaktion, tulee maksukyvyttömäksi tai muuten laiminlyö velvoitteensa, erityisesti silloin, kun kyseessä on pörssin ulkopuolella tehtävä (over-the-counter) johdannaiskauppa tai arvopaperien lainaksiantaminen. Tällainen tapahtuma voi aiheuttaa rahaston nettoarvon huomattavan laskun. Rahastoa koskevista määräyksistä johtuen tämä riski ei voi yksittäisen vastapuolen osalta ylittää 10 prosenttia rahaston kokonaisvarallisuudesta.
- **Johdannaisten käytöstä johtuva riski:** Rahasto sijoittaa johdannaisinstrumentteihin, joihin liittyy eri tyyppisiä riskejä kuten (muun muassa) vipuvaikutusriski, lisääntyneeseen volatiliiteettiin liittyvä riski, arvostusriski tai likviditeettiriski. Tämän riskin realisoiduminen voi aiheuttaa rahaston nettoarvon huomattavan laskun.
- **Operatiivinen riski:** Toimintahäiriöt rahastoyhtiön tai sen edustajien operatiivisissa järjestelmissä voivat aiheuttaa tappioita, merkintä-, vaihto- ja lunastustoimeksiantojen käsittelyviiveitä tai muun tyyppisiä häiriöitä.
- **Liquidity risk:** In certain circumstances, for example in case of low trading volume on financial markets, any buy or sale trade on financial instruments held by the Fund or having an impact on its value may lead to important variations of their valuations. In such circumstances, the net asset value of the Fund could be negatively affected.
- **Luottoriski:** Rahastoon kohdistuu riski siitä, että liikkeeseenlaskija tulee maksukyvyttömäksi, tai jokin tapahtuma vaikuttaa liikkeeseenlaskijan luottolaatuun. Tällaisen riskin tai tapahtuman seurauksena rahaston nettoarvo voi laskea.

Tämän rahaston kulut

Maksettavat kulut käytetään rahaston toimintakustannusten maksamiseen, mukaan lukien markkinointi- ja jakelukustannukset. Nämä kulut vähentävät sijoituksen mahdollista kasvua. Lisätietoja kuluista on rahaston rahastoestitteen kuluja koskevassa osiossa. Rahastoestite on luettavissa osoitteessa www.amundiETF.com.

Sijoittamista edeltävät tai seuraavat kertamaksut	
Merkintäpalkkio:	Ei koske jälkimarkkinasijoittajia*
Lunastuspalkkio:	Ei koske jälkimarkkinasijoittajia*
Tämä on enimmäismäärä, joka sijoituksesta voidaan veloittaa kuluina ennen sijoittamista ja ennen sijoituksen tuoton maksamista. *Jälkimarkkinat: koska rahasto on ETF-rahasto, muut kuin valtuutetut osapuolet voivat yleensä myydä tai ostaa osakkeita vain jälkimarkkinoilla. Sijoittajat maksavat näin ollen arvopaperipörsseissä tapahtuvaan kaupankäyntiinsä liittyvät välityspalkkiot ja/tai kaupankäyntikulut. Näitä välityspalkkioita ja/tai kaupankäyntikuluja ei makseta rahastolle eikä rahastoyhtiölle, vaan sijoittajan omalle välittäjälle. Lisäksi osakkeiden osto- ja myyntikurssin erosta aiheutuneet kustannukset saatetaan veloittaa sijoittajilta. Ensimmäiset: Suoraan rahaston kanssa kauppaa käyvät valtuutetut osapuolet maksavat vastaavat ensimmäisten kaupankäyntikulut.	
Lisätietoja on rahaston rahastoestitteen asiaa koskevissa osioissa.	
Rahastosta vuoden aikana veloitettavat maksut	
Juoksevat kulut:	0,25 %.
Tässä esitetty juoksevien kulujen määrä on arvio. Arviossa on huomioitu 26. helmikuuta 2021 voimaan tullut hallinnointipalkkioiden lasku. Tässä esitetty luku vastaa mainitun päivämäärän jälkeistä palkkiota ja poikkeaa vuoden aikana tosiasiallisesti veloitetuista kuluista, jotka sisältävät kulut myös muutoista edeltäneeltä ajalta. Tosiasiallisesti veloitetuista kuluista on tiedot yhteissijoitusyrityksen kunkin tilikauden vuosikatsauksessa. Se ei sisällä tulosperusteisia palkkioita eikä kaupankäyntikuluja paitsi sijoituskohteena olevan yhteissijoitusyrityksen osakkeiden/osuuksien ostamisesta tai myymisestä maksetut merkintä- ja lunastuspalkkiot.	
Rahastosta tietyissä erityisolosuhteissa veloitettavat maksut	
Tulosperusteinen palkkio:	Ei sovelleta.

Aiempi tuotto- tai arvonkehitys



Aiempi tuotto- tai arvonkehitys ei ole luotettava osoitus tulevasta kehityksestä. Tuotto esitetään euroina (EUR) kaikkien rahaston kulujen vähentämisen jälkeen. Rahasto on perustettu 25. lokakuuta 2018.

Kun vertailuindeksi on muun kuin rahaston valuutan määräinen, vertailuindeksin kehitys muunnetaan vertailutarkoituksessa rahaston valuutan määräiseksi. Vertailuindeksin arvo muunnetaan päivittäin käyttäen WM/Reuters-valuuttakurssia klo 17 Keski-Euroopan aikaa kunakin päivänä.

- (*) 8.3.2017 saakka rahaston vertailuindeksi oli "Markit iBoxx EUR Liquid High Yield 30 Ex-Financial".
- (*) 25.10.2018 saakka rahaston ilmoitettu tuotto vastaa MULTI UNITS FRANCE - Lyxor BofAML € High Yield Ex-Financial Bond UCITS ETF -alarahaston ("sulautettu rahasto") tuottoa. Tämä rahasto sulautettiin rahastoon 25.10.2018.
- (*) 15.3.2021 saakka rahaston tässä esitetty tuotto- tai arvonkehitys perustuu vertailuindeksin epäsuoraan replikointiin. 16.3.2021 alkaen rahaston tässä esitetty tuotto- tai arvonkehitys perustuu vertailuindeksin suoraan replikointiin.
- (*) 10.3.2021 saakka rahaston vertailuindeksi oli BofA Merrill Lynch BB-CCC Euro Developed Markets Non-Financial High Yield Constr Index.

Käytännön tiedot

- Säilytysyhteisö:** Société Générale Luxembourg.
Muut rahastoa koskevat käytännön tiedot, uusin rahastoestite sekä tuorein vuosikertomus ja puolivuotiskatsaus ovat saatavilla veloituksetta englanniksi ja ranskaksi rahastoyhtiön asiakaspalveluosastolta osoitteesta 91-93, boulevard Pasteur, 75015 Pariisi, Ranska.
Rahasto on Lyxor Index Fund -yhtiön alarahasto. Rahastoestite, uusin rahastoestite sekä tuorein vuosikertomus ja puolivuotiskatsaus laaditaan koko yhtiölle. Kunkin alarahaston varat ja vastuut ovat lakisääteisesti erillisiä (eli rahaston varoja ei voida käyttää yhtiön muiden alarahastojen vastuiden kattamiseen). Alarahastojen välisiin vaihtoihin mahdollisesti sovellettavat vaihtosäännöt on kuvattu yhtiön rahastoestiteessä.
- Lisätietoja:** substanssiarvon ja (mahdollisia) muita osuuslajeja koskevia tietoja saa osoitteesta www.amundiETF.com.
Arvopaperinvälittäjiä, kaupankäyntipaikkoja ja kaupankäyntimenettelyitä koskevia tietoja saa rahastoa koskevalta sivulta osoitteesta www.amundiETF.com.
Pörssiä operoiva yhtiö julkaisee suuntaa-antavan substanssiarvon reaaliaikaisesti kaupankäyntiaikoina.
- Verotus:** rahaston kotivaltion verolainsäädäntö voi vaikuttaa sijoittajan henkilökohtaiseen verotukseen. Sijoittajaa kehoitetaan pyytämään lisätietoja omalta veroneuvonantajaltaan.
Amundi Asset Management voidaan saattaa vastuuseen vain sillä perusteella, että tämä asiakirja sisältää harhaanjohtavia tai epätarkkoja tietoja tai tietoja, jotka ovat ristiriidassa rahaston rahastoestitteen vastaavien osien kanssa.
Rahastoyhtiön ajantasaiset palkka- ja palkkiopolitiikkaa koskevat tiedot saa osoitteesta www.amundiETF.com tai maksutta pyytämällä niitä kirjallisesti rahastoyhtiöltä. Palkka- ja palkkiopolitiikassa kuvataan tiettyjen työntekijäryhmien palkkojen ja palkkioiden sekä korvausten laskentatapa, niiden myöntämisestä vastaavat tahot sekä palkka- ja palkkiokomitean kokoonpano.
Rahastolle on myöntänyt toimiluvan Luxemburg, ja sitä valvoo Commission de surveillance du secteur financier. Amundi Asset Managementia valvoo Autorité des marchés financiers.
Nämä sijoittajan avaintiedot ovat ajantasaisia 1. kesäkuuta 2022.