

INFORMATIONS CLÉS POUR L'INVESTISSEUR

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de ce fonds. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce fonds et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

Lyxor Smart Overnight Return - IE (le « Fonds »)

ISIN : LU1190418134 - Compartiment de la société d'investissement dénommée Lyxor Index Fund (la « Société ») domiciliée au Luxembourg.
Géré par Amundi Asset Management, une filiale du groupe Amundi

Objectifs et politique d'investissement

Le Fonds est un OPCVM actif.

L'objectif d'investissement du Fonds est de générer un rendement lié aux taux du marché monétaire. Le taux de référence du Fonds est le taux €STR capitalisé (l'« Indice de référence »). Le Fonds est géré activement en investissant dans un portefeuille diversifié d'instruments financiers dans un environnement au risque et à la liquidité strictement contrôlés. La majorité des investissements ou de l'exposition du Fonds sont liés à l'Indice de référence. La stratégie d'investissement du Fonds est liée à l'Indice de référence, tout écart par rapport à l'Indice de référence est dès lors limité.

Le taux €STR (taux en euro à court terme) reflète les coûts d'emprunt au jour le jour en euros non garantis pour les banques de la zone euro. Le taux €STR utilise les données de transactions issues des rapports de change quotidiens produits par les 52 plus grandes banques de la zone euro. Il correspond au taux d'intérêt moyen sur les prêts réalisés durant la journée.

Le taux €STR capitalisé quotidiennement est calculé et publié par la BCE. Le taux €STR est publié chaque jour ouvré sur la base des transactions réalisées et réglées le jour ouvré précédent (la date de reporting « T ») avec une date d'échéance de T+1 qui sont considérées comme avoir été exécutées aux conditions du marché et qui reflètent donc les taux du marché de façon non biaisée.

Le Fonds ne bénéficie d'aucune garantie implicite ou explicite, que ce soit d'une contrepartie de swap ou de toute entité agissant en tant que distributeur du Fonds.

Le taux de référence €STR peut être négatif, ce qui pourrait amener le Fonds à enregistrer une performance négative.

La composition actualisée des positions du Fonds est disponible sur le site Internet www.amundiief.com.

En outre, la valeur liquidative indicative est publiée sur les pages Reuters et Bloomberg consacrées au Fonds, et peut également être mentionnée sur les sites Internet des places de cotation du Fonds.

La devise de la classe d'actions est l'euro (EUR).

- **Instruments financiers investis** : pour réaliser son objectif d'investissement, l'univers d'investissement du Compartiment est constitué : - d'instruments du marché monétaire, notamment des dépôts de liquidités auprès d'établissements de crédit ; - de valeurs mobilières (y compris des actions et des titres de créance à taux fixe ou variable), de parts ou d'actions d'OPCVM conformes à la Directive OPCVM ; - d'instruments financiers dérivés, notamment : des swaps sur le marché monétaire, des contrats de change à terme et des swaps de change destinés exclusivement à couvrir les risques de change, et des swaps de taux d'intérêt visant à réduire les risques de taux d'intérêt.
- des techniques de gestion efficace du portefeuille, notamment : des prêts et emprunts de titres, des prises et des mises en pensions de valeurs mobilières (y compris d'actions et de titres de créance fixe ou variable).
Le Compartiment peut également détenir des liquidités.
- **Politique de dividendes** : les revenus du Fonds (le cas échéant) ne seront pas distribués aux Actionnaires, mais réinvestis.
- **Valeur liquidative** : La Valeur liquidative par action est calculée chaque Jour d'évaluation.
- **Rachats** : les demandes de rachat devront être reçues au plus tard à 13 h 00, heure d'Europe/du Luxembourg, chaque Jour de valorisation (J). Pour de plus amples informations, veuillez vous référer au prospectus du Fonds.

Profil de risque et de rendement



Le rapport risque-rendement ci-dessus est basé sur la performance historique des actifs inclus dans le Fonds ou celle de son indice de référence, ou sur la performance calculée d'un portefeuille modèle. Ainsi, cette estimation du risque peut ne pas être un indicateur fiable du risque futur et est susceptible d'évoluer dans le temps. La catégorie la plus basse ne correspond pas à un investissement sans risque.

Le Fonds a été classé en catégorie 1. La catégorie 1 indique qu'une perte en capital est possible, mais très improbable dans des conditions normales de marché.

Principaux risques non pris en compte dans l'indicateur ci-dessus et pouvant entraîner une baisse de la valeur liquidative du Fonds et que le Fonds est autorisé à faire figurer dans ce document (pour plus d'information sur les risques, se référer à la section Profil de risque du prospectus) :

- **Risque de contrepartie** : le Fonds est exposé au risque qu'une contrepartie avec laquelle il a conclu un contrat ou une transaction devienne insolvable ou soit défaillante d'une autre manière, notamment lorsqu'il a conclu des transactions sur des instruments financiers dérivés, de gré à gré ou de prêts de titres. Si un tel événement se produit, cela peut entraîner une forte baisse de la valeur liquidative du Fonds. Conformément à la réglementation applicable au Fonds, ce risque ne peut pas excéder 10 % de l'actif total du Fonds par contrepartie.
- **Risque lié aux instruments financiers dérivés** : le Fonds investit dans des instruments financiers dérivés. Ces instruments financiers dérivés peuvent présenter certains risques tels que (sans s'y limiter), le risque lié à l'effet de levier, le risque de volatilité élevée, le risque de valorisation ou le risque de liquidité. Si un tel risque se produit, cela peut entraîner une forte baisse de la valeur liquidative du Fonds.
- **Risque opérationnel** : en cas de défaillance opérationnelle de la société de gestion ou de l'un de ses représentants, les investisseurs pourraient subir une perte, un retard dans le traitement des ordres de souscription, de conversion, de rachat ou autres perturbations.
- **Risque de crédit** : le Fonds est exposé au risque qu'un émetteur devienne insolvable ou à tout autre événement pouvant avoir un impact sur la qualité de crédit de cet émetteur. La conséquence de ce risque ou de cet événement peut entraîner une baisse de la valeur liquidative du Fonds.

Frais

Les frais que vous payez permettent de couvrir les coûts de gestion du Fonds, y compris les coûts de promotion et de distribution. Ces frais diminuent la performance potentielle de votre investissement. Pour plus d'information concernant les frais, veuillez vous référer à la section Frais du prospectus du Fonds, disponible sur le site Internet www.amundi.com.

Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement

Frais d'entrée : S/O.

Frais de sortie : S/O.

Le pourcentage indiqué est le maximum pouvant être prélevé sur votre capital avant que celui-ci ne soit investi ou avant que le revenu de votre investissement ne vous soit distribué. Les investisseurs peuvent demander à leur conseiller financier ou à leur distributeur le montant exact des frais d'entrée et de sortie.

Frais prélevés par le Fonds sur une année.

Frais courants : 0,05 %.

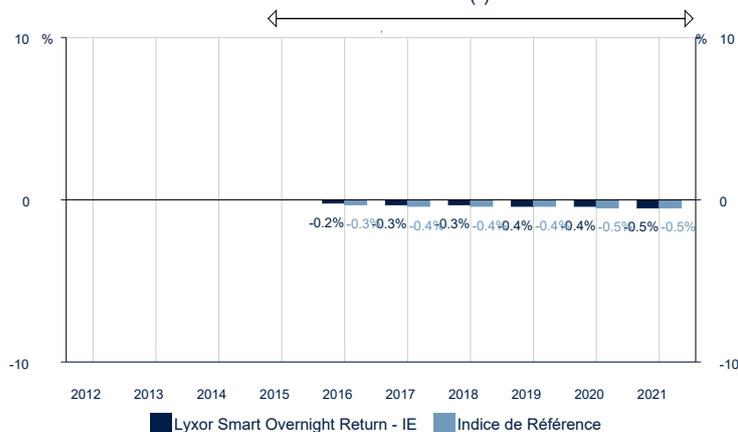
Le taux des frais courants est fondé sur les frais de l'exercice précédent (impôts compris, le cas échéant), pour l'exercice clos en octobre 2021 et peut varier d'un exercice à l'autre. Il ne prend en compte ni les commissions de performance ni les coûts de transaction du portefeuille, mais comprend les frais d'entrée et de sortie payés par le Fonds lorsqu'il achète ou vend des parts ou des actions d'autres organismes de placement collectif.

Frais prélevés par le Fonds dans certaines circonstances particulières

Commission de performance : Néant.

Performances passées

Performance annuelle de
Lyxor Smart Overnight Return - IE (en %)
(*)



Les performances passées ne constituent pas un indicateur fiable des performances futures. La performance est indiquée en euros (EUR), nette de tous les frais à la charge du Fonds. Le Fonds a été lancé le 2 mars 2015.

(*) Du 2 mars 2015 au 31 décembre 2021, l'indice de référence utilisé à des fins de comparaison de la performance était le taux EONIA capitalisé. Depuis le 1er janvier 2022, l'Indice de référence est le taux €STR capitalisé.

Informations pratiques

- **Dépositaire :** Société Générale Luxembourg.

De plus amples informations pratiques relatives au Fonds, au dernier prospectus en date, aux derniers rapports annuels et à tout rapport semestriel, le cas échéant, sont mises à disposition en français et en anglais, gratuitement, auprès du service à la clientèle de la société de gestion, 91-93, boulevard Pasteur, 75015 Paris, France.

Le Fonds est un compartiment de la société Lyxor Index Fund. Le prospectus, ainsi que les derniers rapports annuel et semestriel sont établis pour l'ensemble de la Société.

L'actif et le passif de chaque compartiment sont ségrégués en vertu de la loi (c'est-à-dire que l'actif du Fonds ne peut être utilisé pour payer le passif d'autres compartiments de la Société). Si applicables, les règles de conversion de parts entre compartiments sont détaillées dans le prospectus de la Société.

- **Informations supplémentaires :** la valeur liquidative et d'autres informations concernant la classe d'actions (le cas échéant) sont disponibles sur le site Internet www.amundi.com.

Les informations relatives aux teneurs de marché, aux bourses, ainsi qu'à la négociation sont disponibles sur la page dédiée au Fonds sur le site Internet www.amundi.com. La valeur liquidative indicative est publiée en temps réel par les bourses pendant les heures de négoce.

- **Fiscalité :** la législation fiscale applicable dans l'État membre où le Fonds est enregistré peut affecter les investisseurs. Pour plus d'informations, veuillez contacter votre conseiller fiscal habituel.

La responsabilité d'Amundi Asset Management ne peut être engagée que sur la base de déclarations contenues dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du prospectus du Fonds.

Les informations relatives à la politique de rémunération à jour de la société de gestion sont disponibles sur le site Internet www.amundi.com, ou gratuitement sur demande écrite auprès de la société de gestion. Cette politique décrit notamment les méthodes utilisées pour calculer la rémunération et les bénéfices de certaines catégories de collaborateurs, les organes chargés de leur allocation, ainsi que la composition du Comité de rémunération.

Le Fonds est agréé au Luxembourg et réglementé par la Commission de Surveillance du Secteur Financier. Amundi Asset Management est réglementée par l'Autorité des marchés financiers.

Les informations clés pour l'investisseur présentées ici sont exactes et à jour au 01 juin 2022.