

# DATOS FUNDAMENTALES PARA EL INVERSOR

El presente documento recoge los datos fundamentales sobre este fondo que el inversor debe conocer. No se trata de material promocional. La ley exige que se facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del fondo y los riesgos que comporta invertir en él. Le recomendamos que la lea para que, de esta manera, pueda tomar una decisión fundada sobre la inversión.

## Lyxor \$ Floating Rate Note UCITS ETF - D-USD (en lo sucesivo, el "Fondo")

ISIN: LU1571051751 - Subfondo de la sociedad de inversión denominada Lyxor Index Fund (en lo sucesivo, la "Sociedad") domiciliada en Luxemburgo. Gestionado por Lyxor International Asset Management S.A.S. ("LIAM")

### Objetivos y política de inversión

El objetivo de inversión del Fondo es replicar la evolución tanto al alza como a la baja del Índice Bloomberg Barclays US Corporate FRN 2-7 (el "Índice"), denominado en dólares estadounidenses (USD), representativo del rendimiento del mercado de obligaciones de empresas a tipo variable en USD. El Índice proporciona una representación equilibrada del mercado de obligaciones de tipo variable en USD.

Se espera que el nivel previsto del error de seguimiento en condiciones normales de mercado sea del 0,08%.

El Fondo pretende lograr su objetivo a través de la reproducción indirecta mediante la celebración de un contrato de permuta financiera extrabursátil (instrumento financiero derivado, el "IFD").

El Fondo también podrá invertir en una cartera diversificada de bonos internacionales, cuya rentabilidad se cambiará por el valor de los títulos que le permitan alcanzar su objetivo de inversión, que en muchos casos serán los títulos subyacentes el Índice". La composición actualizada de las posiciones del Fondo se encuentra disponible en [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com).

Asimismo, el valor liquidativo indicativo se publica en las páginas del Fondo en Reuters y Bloomberg, y es posible que también se mencione en los sitios web de las bolsas en las que cotiza el Fondo.

La divisa de las acciones es el dólar estadounidense (USD).

- **Instrumentos financieros en los que se invierte:** Derivados, bonos internacionales, OICVM
- **Política de dividendos:** los ingresos del Fondo disponibles para distribución (en caso de haberlos) se distribuirán.
- **Valor Liquidativo:** se calcula diariamente siempre que las bolsas correspondientes hayan abierto a negociación y puedan cubrirse las órdenes.
- **Reembolsos:** los inversores pueden solicitar el reembolso de sus acciones en el mercado primario cada día de valoración antes de las 18.30 (Europa/Luxemburgo) y venderlas en el mercado secundario en cualquier momento durante las horas de negociación en los lugares donde cotiza el Fondo.

### Perfil de riesgo y remuneración



La categoría riesgo-remuneración que se muestra más arriba está basada en la rentabilidad histórica de los activos incluidos en el Fondo o en la de su índice de referencia. Por consiguiente, es posible que la estimación del riesgo no constituya un indicador fiable del riesgo futuro y esté sujeta a variación a lo largo del tiempo. La asignación a la categoría más baja no significa que la inversión esté libre de riesgo.

Como consecuencia de su exposición al Índice de Referencia, el Fondo ha sido clasificado dentro de la categoría 2. La categoría 2 indica que la pérdida del capital es posible, aunque sea muy improbable en condiciones normales de mercado.

Principales riesgos no cubiertos por el indicador anterior que podrían llevar a un descenso del valor liquidativo del Fondo y sobre los que el Fondo está autorizado a informar en el presente documento (para más información sobre los riesgos, consulte la sección de Perfil de Riesgo del folleto):

- **Riesgo de contraparte:** el Fondo está expuesto al riesgo de quiebra o a cualquier otro tipo de incumplimiento de las contrapartes con las que haya formalizado operaciones de negociación.
- **Riesgo de utilización de instrumentos financieros derivados:** con el fin de alcanzar su objetivo de inversión, el Fondo formalizará los instrumentos financieros derivados OTC que le permitan lograr la rentabilidad del Índice de Referencia. Los instrumentos financieros derivados podrían verse afectados por diferentes riesgos, como una modificación de la legislación o las medidas fiscales.
- **Riesgo de crédito del emisor:** el Fondo podría verse afectado por el cambio de la calidad crediticia del emisor, lo que modificaría el riesgo de impago del emisor y alteraría el valor del bono.

## Gastos del Fondo

Los gastos que usted soporta están destinados a sufragar los costes de gestión del Subfondo, incluidos los de comercialización y distribución. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de su inversión.

Si desea más información sobre los gastos, consulte la sección de gastos correspondiente del folleto del Fondo que se encuentra disponible en [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com).

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión	
<b>Gastos de entrada aplicables únicamente en el mercado primario:</b>	Como máximo el superior entre (i) <b>50.000</b> euros por solicitud de suscripción y el (ii) <b>5 %</b> del valor del patrimonio neto por acción multiplicado por el número de acciones suscritas.
<b>Gastos de salida aplicables únicamente en el mercado primario:</b>	Como máximo el superior entre (i) <b>50.000</b> euros por solicitud de reembolso y el (ii) <b>5 %</b> del valor del patrimonio neto por acción multiplicado por el número de acciones reembolsadas.
Este es el máximo que puede detrarse de su capital antes de proceder a la inversión y antes de abonar el producto de la inversión. Los inversores pueden obtener información acerca de los gastos efectivos de entrada y salida a través de su asesor financiero o distribuidor. <b>No se aplicarán gastos de entrada ni de salida en las inversiones por medio de las bolsas donde cotice el Fondo, aunque es posible que sí sean aplicables otras comisiones, como la de corretaje.</b>	
Gastos detrídos del fondo a lo largo de un año.	
<b>Gastos corrientes:</b>	0,15%.
Este porcentaje de gastos corrientes es una estimación del porcentaje de gastos (incluidos impuestos, si procede) que el Fondo puede soportar en el año corriente. No incluye las comisiones de rentabilidad ni los costes de operación de la cartera, salvo en caso de que el Fondo haya abonado un gasto de entrada/salida al comprar o vender participaciones o acciones de instituciones de inversión colectiva subyacentes.	
Gastos detrídos del fondo en determinadas condiciones específicas	
<b>Comisión de rentabilidad:</b>	No aplicable.

## Rentabilidad histórica

La rentabilidad histórica no es un indicador fiable de la rentabilidad futura.

El rendimiento se publica en dólares estadounidenses (USD) libre de todo gasto cargado al Fondo.

El Fondo se constituyó el 6 de abril de 2017.

### RENTABILIDAD ANUAL DEL Lyxor \$ Floating Rate Note UCITS ETF - D-USD (en %)

- Los datos disponibles son insuficientes para proporcionar a los inversores del Fondo una indicación de la rentabilidad histórica que resulte de utilidad -

## Información práctica

- **Depositario:** Société Générale Bank & Trust.
- **Fiscalidad:** la legislación fiscal aplicable en el Estado miembro en que el Fondo esté domiciliado puede afectar a los inversores.
- **Información complementaria:** la información sobre el folleto del fondo, el valor de inventario neto y sobre otras clases de acciones (en su caso), se encuentra disponible en [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com).

Los detalles de la política de remuneración están disponibles en [www.lyxor.com](http://www.lyxor.com).

El folleto, los detalles de la política de remuneración, el último informe anual y el informe semestral se encuentran disponibles también en inglés o en francés de forma gratuita, solicitándolo a Lyxor Asset Management, Client Servicing, 17, Cours Valmy, Tour Société Générale, 92800 Puteaux (FRANCIA).

LIAM únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto del Fondo.

El folleto y los informes periódicos se refieren al conjunto de la Sociedad. Los activos y pasivos de cada subfondo de la Sociedad están segregados por ley. En su caso, las reglas de conversión entre subfondos (y sus comisiones correspondientes, si las hubiera) se detallan en el folleto.

El Fondo está autorizado en Luxemburgo y está regulado por la Commission de Surveillance du Secteur Financier (comisión de supervisión del sector financiero de Luxemburgo).

LIAM está regulada por la *Autorité des marchés financiers* (autoridad de los mercados financieros de Francia).

Los presentes datos fundamentales para el inversor son exactos y están actualizados a viernes, 30 de junio de 2017.