# 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 le 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.

ASSET MANAGEMENT BY LYXOR
SOCIETE GENERALE GROUP

## Lyxor $ Floating Rate Note UCITS ETF - Monthly Hedged to EUR - Dist (en lo sucesivo, el "Fondo")

ISIN: LU1571052130 - Subfondo de la sociedad de inversión denominada Lyxor Index Fund (en lo sucesivo, la "Sociedad") con domicilio sito en Luxemburgo.
Gestionado por Lyxor International Asset Management S.A.S. (en lo sucesivo, "LIAM")

## Objetivos y política de inversión

El objetivo de inversión del Fondo es seguir la evolución, tanto al alza como a la baja, del índice Bloomberg Barclays US Corporate FRN 2-7 Yr (en lo sucesivo, el "**Índice de referencia**") denominado en dólares estadounidenses (USD) y representativo de la rentabilidad del mercado de bonos corporativos con interés variable en USD, minimizando al mismo tiempo la volatilidad de la diferencia entre el rendimiento del Fondo y el del Índice de referencia (en lo sucesivo, la "**Desviación**").
El Fondo es un instrumento de gestión pasiva.
El nivel previsto de desviación en condiciones de mercado normales se indica en el folleto del Fondo.
El Fondo también utilizará una estrategia mensual de cobertura de divisas, con vistas a reducir el impacto de los cambios en la divisa del Fondo con respecto a la divisa de los componentes del Índice de referencia.
El sitio web de Barclays (index.barcap.com) contiene información más detallada sobre los índices de Barclays.

LIAM informa a los inversores de que el Índice de referencia pasará a ser el índice "Bloomberg Barclays MSCI USD Corporate Liquid FRN 0-5 Year SRI Sustainable" (en lo sucesivo, el "**Nuevo índice de referencia**"). El cambio del Índice de referencia al Nuevo índice de referencia se implementará durante un periodo de 11 Días hábiles que comenzará el 29 de julio de 2019 y terminará el 12 de agosto de 2019. Durante dicho periodo, la rentabilidad del Subfondo diferirá de la del Índice de referencia.
El Fondo pretende alcanzar su objetivo por medio de una replicación indirecta; es decir, formalizando un contrato de permuta en mercados extrabursátiles (OTC) (instrumentos financieros derivados). El Fondo también podrá invertir en una cartera diversificada de títulos de deuda internacionales, cuya rentabilidad se permutará por la del índice de referencia por medio de instrumentos financieros derivados. Puede consultar la composición actualizada de las participaciones del Fondo en la web 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 cotice el Fondo.
La moneda de la acción es el euro (EUR).

- **Instrumentos financieros en los que se invierte:** Bonos internacionales, instrumentos financieros derivados.
- **Política de dividendos:** las cuantías del Fondo disponibles para su distribución (si las hubiera) 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

Menor riesgo ← → Mayor riesgo

Potencialmente menor remuneración — Potencialmente mayor remuneración

| 1 | **2** | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|

La categoría de riesgo-remuneración que se muestra anteriormente está basada en la rentabilidad histórica de los activos incluidos en el Fondo, en la de su índice de referencia o en la de un modelo de cartera. 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 que cualquier contraparte con la que haya formalizado un contrato o transacción pueda declararse insolvente o en otra situación de impago y, más concretamente, en la ejecución de instrumentos financieros derivados extrabursátiles u operaciones de préstamo de valores. Si se produce tal suceso, el valor liquidativo del Fondo puede disminuir significativamente. Según el reglamento aplicable al Fondo, este riesgo no puede superar el 10 % de los activos totales del Fondo por contraparte.
- **Riesgo de instrumentos financieros derivados**: El Fondo invierte en instrumentos financieros derivados. Estos instrumentos financieros derivados pueden llevar aparejados diferentes tipos de riesgos, por ejemplo (sin carácter restrictivo) el riesgo de apalancamiento, el riesgo de volatilidad elevada, el riesgo de valoración o el riesgo de liquidez. Si se materializa alguno de estos riesgos, el valor liquidativo del Fondo puede disminuir significativamente.
- **Riesgo de crédito**: El Fondo está expuesto al riesgo de que cualquier emisor pueda declararse insolvente o a cualquier otra situación que pueda afectar a la calidad crediticia de dicho emisor. Este riesgo o situación podría generar un descenso del valor liquidativo del Fondo.
- **Riesgo operativo:** En caso de fallo operativo en la sociedad de gestión o uno de sus representantes, los inversores podrían sufrir pérdidas, retrasos en la tramitación de las suscripciones, conversiones, órdenes de reembolso u otras molestias.
- **Riesgo de liquidez:** En determinadas circunstancias, por ejemplo en caso de un volumen de negociación reducido en los mercados financieros, cualquier operación de compraventa de instrumentos financieros mantenidos por el Fondo o que afecte a su valor puede ocasionar importantes variaciones en sus valoraciones. Esto podría incidir negativamente en el valor liquidativo del Fondo.

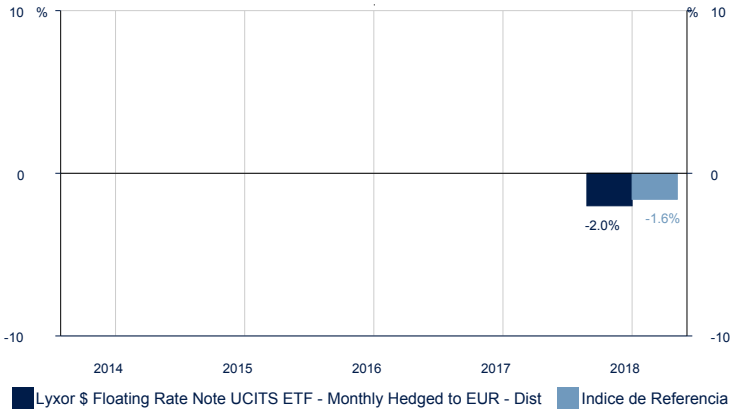
## Gastos del Fondo

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**.

| Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión | |
|---|---|
| **Gastos de entrada aplicables únicamente en el mercado primario:** | Como máximo,el superior entre **(i) 50 000** euros por solicitud de suscripción y el **(ii) 5** % del valor del patrimonio neto por acción multiplicado por el número de acciones suscritas. |
| **Gastos de salida aplicables únicamente en el mercado primario:** | Como máximo, el superior entre **(i) 50 000** euros por solicitud de reembolso y el **(ii) 5** % del valor del patrimonio neto por acción multiplicado por el número de acciones reembolsadas. |
| Este es el máximo que puede detraerse 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.<br>**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.** | |
| Gastos detraídos del Fondo a lo largo de un año. | |
| **Gastos corrientes:** | 0,15%. |
| La tasa de gastos corrientes se basa en los gastos del año pasado (incluidos impuestos, si procede) para el ejercicio cerrado en octubre de 2018, y podría variar de un año a otro. 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 detraídos del Fondo en determinadas condiciones específicas | |
| **Comisión de rentabilidad:** | No aplicable. |

## Rentabilidad histórica

Rentabilidad anual del
Lyxor $ Floating Rate Note UCITS ETF - Monthly Hedged to EUR - Dist (en %)




La rentabilidad histórica no es un indicador fiable de la rentabilidad futura. La rentabilidad se indica en euros (EUR) y libre de todas las comisiones que deba sufragar el Fondo. El Fondo se constituyó el 6 de abril de 2017.

El Fondo hace un seguimiento del Índice de referencia y utiliza una estrategia de cobertura de divisas. Dicha estrategia se ajusta, en todo lo posible, a la metodología desarrollada por el proveedor del Índice de referencia para determinar los índices de cobertura de divisas. Se compara la rentabilidad del índice de cobertura de divisas con la del Fondo, el cual aplica la metodología de cobertura de dicho índice.

## Información práctica

- **Depositario:** Société Générale Bank & Trust.

Dispone de otra información práctica sobre el Fondo, la última versión del folleto y los últimos informes anuales, así como cualquier informe semestral posterior (en francés o inglés) de forma gratuita a través del departamento de atención al cliente de la sociedad gestora, en la dirección 17, Cours de Valmy, Tour Société Générale 92800 Puteaux, FRANCIA.

El Fondo es un subfondo de la Sociedad Lyxor Index Fund. El folleto, los últimos informes anuales y cualquier informe semestral posterior se preparan para toda la Sociedad.

Los activos y pasivos de cada Subfondo están segregados por ley (es decir, los activos del Fondo no pueden ser utilizados para hacer frente a los pasivos de otros subfondos de la Sociedad). Si procede, las normas de conversión entre subfondos se detallan en el folleto en la Sociedad.

- **Información adicional:** el valor liquidativo y otra información sobre las clases de participaciones (en su caso) están disponibles en **www.lyxoretf.com**.

Podrá acceder a información sobre creadores de mercado, bolsas de valores y demás datos de negociación en la página dedicada al Fondo en la web **www.lyxoretf.com**. El valor liquidativo indicativo es publicado en tiempo real por la bolsa de valores durante el horario de negociación.

- **Fiscalidad:** la legislación fiscal aplicable en el Estado miembro en que el Fondo esté registrado puede afectar a los inversores. Póngase en contacto con su asesor fiscal habitual para obtener información adicional.

Lyxor International Asset Management 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.

La información detallada sobre la política de remuneración actualizada de la sociedad gestora puede consultarse en **www.lyxor.com** o sin coste alguno previa solicitud por escrito a la sociedad gestora. Esta política describe, en particular, los métodos de cálculo de la remuneración y los beneficios de determinadas categorías de empleados, los organismos encargados de su asignación y la composición del Comité de remuneración.

El Fondo está autorizado en Luxemburgo y supervisado por la Comisión de Supervisión del Sector Financiero (Commission de Surveillance du Secteur Financier, CSSF). Lyxor International Asset Management está regulada por la Autoridad de los Mercados Financieros francesa (Autorité des Marchés Financiers, AMF).

Los presentes datos fundamentales para el inversor son exactos y están actualizados a 29 julio 2019.