

# 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 UCITS ETF D-EUR (le « Fonds »)

ISIN : LU2082999306 - Un compartiment de la société de gestion d'actifs Lyxor Index Fund (la « Société ») domiciliée au Luxembourg.

Géré par Lyxor International Asset Management S.A.S. (« LIAM »)

## Objectifs et politique d'investissement

L'objectif d'investissement du Fonds est de générer un rendement lié au taux du marché monétaire.

Le taux de référence du Fonds est le taux EONIA 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.

Le taux EONIA (Euro Overnight Index Average) est un taux d'intérêt effectif au jour le jour calculé comme la moyenne pondérée de toutes les transactions au jour le jour non garanties exécutées sur le marché interbancaire en euros.

Les taux de référence de l'EONIA sont calculés par la Banque centrale européenne, sur la base de tous les actifs interbancaires au jour le jour créés avant la fermeture des systèmes RBTR à 18 h HEC, et sont publiés par Thomson Reuters tous les jours avant 19 h HEC.

L'EONIA capitalisé quotidiennement intègre l'impact du réinvestissement des intérêts perçus selon la méthodologie des OIS (Overnight Indexed Swap).

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

Le taux de référence de l'EONIA peut être négatif, ce qui pourrait amener le Compartiment à enregistrer une performance négative.

La composition actualisée du portefeuille de titres détenu par le Fonds est mentionnée sur le site [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.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 part 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 montants distribuables du Fonds (le cas échéant) seront distribués.
- **Valeur liquidative** : la Valeur liquidative par action est calculée chaque jour d'évaluation.
- **Rachats** : Les investisseurs peuvent racheter leurs actions sur le marché primaire chaque jour d'évaluation avant 13h00 (heure d'Europe/du Luxembourg) et les vendre sur le marché secondaire et à n'importe quel moment pendant les heures d'ouverture des places où le Fonds est coté.

## 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 compte tenu de son exposition à l'Indice de référence. 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.

### INFORMATIONS DESTINÉES AUX INVESTISSEURS EN SUISSE

#### ■ Représentant Suisse et service de paiement en Suisse

Société Générale, Paris, succursale de Zurich, Talacker 50, Case postale 5070, 8021 Zurich, exerce les fonctions de représentant du Fonds en Suisse.

Société Générale, Paris, succursale de Zurich, assure également le service de paiement pour le compte du Fonds en Suisse.

#### ■ Lieu de distribution des documents déterminants

Le prospectus et le Key Investor Information Document, les statuts/le contrat du Fonds ainsi que les rapports annuels et semestriels du Fonds peuvent être obtenus sur simple demande et sans frais au siège du Représentant Suisse.

#### ■ Publications

En Suisse, les publications ou notifications du Fonds seront faites sur la plateforme électronique [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com).

La valeur liquidative par part, avec la mention « commissions non comprises », sera publiée chaque jour ouvrable sur la plateforme électronique [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com).

## 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.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.com).

### Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement

<b>Frais d'entrée applicables sur le marché primaire uniquement :</b>	Au maximum, le plus élevé entre (i) <b>50 000</b> euros par demande de souscription et (ii) <b>5 %</b> de la valeur liquidative par action multipliée par le nombre d'actions souscrites.
<b>Frais de sortie applicables sur le marché primaire uniquement :</b>	Au maximum, le plus élevé entre (i) <b>50 000</b> euros par demande de rachat et (ii) <b>5 %</b> de la valeur liquidative par action multipliée par le nombre d'actions rachetées.

Le montant 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 de vous soit distribué. L'investisseur peut demander à son conseiller financier ou à son distributeur le montant exact des frais d'entrée et de sortie.

**Lors d'un investissement via une bourse où le Fonds est coté, aucuns frais d'entrée / de sortie ne s'appliquent, mais d'éventuelles commissions de courtage peuvent être appliquées.**

### Frais prélevés par le Fonds sur une année.

<b>Frais courants :</b>	0,05 %.
-------------------------	---------

Le taux des frais courants indiqué ici est une estimation du pourcentage des frais (impôts compris, le cas échéant) que le Fonds peut être amené à supporter au cours de l'année actuelle. 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 en valeurs mobilières.

### Frais prélevés par le Fonds dans certaines circonstances particulières

<b>Commission de performance :</b>	Aucun.
------------------------------------	--------

## Performances passées

Performance annuelle de  
Lyxor Smart Overnight Return UCITS ETF D-EUR (en %)

- Les données sont insuffisantes pour fournir à l'investisseur  
une indication pertinente de la performance passée de ce Fonds -

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 avril 2020.

## Informations pratiques

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

D'autres informations pratiques sur le Fonds, le dernier prospectus, ainsi que les derniers rapports annuel et semestriel sont disponibles en français et en anglais, gratuitement et sur demande auprès du service à la clientèle de la société de gestion, 17, Cours Valmy, Tour Société Générale, 92800 Puteaux, 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 catégorie d'actions (le cas échéant) sont disponibles sur le site Internet [www.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.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.lyxoretf.com](http://www.lyxoretf.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. Veuillez contacter votre conseiller fiscal habituel pour plus d'information.

La responsabilité de Lyxor International 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.lyxor.com](http://www.lyxor.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 en Luxembourg et réglementé par la Commission de Surveillance du Secteur Financier. Lyxor International Asset Management est réglementée par l'Autorité des marchés financiers.

Les informations clés pour l'investisseur présentées ici sont exactes et à jour au 20 décembre 2019.