

Il presente documento contiene le informazioni chiave di cui tutti gli investitori devono disporre in relazione a questo fondo. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni contenute nel presente documento, richieste dalla legge, hanno lo scopo di aiutare gli investitori a capire la natura di questo fondo e i rischi ad esso connessi. Si raccomanda di prenderne visione, in modo da operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire.

LYXOR EPSILON GLOBAL TREND FUND A-EUR (il "Fondo")

ISIN: IE00B61N8946 - Comparto della società di investimento denominata LYXOR INVESTMENT STRATEGIES PLC (la "Società") con sede in Irlanda. Gestito da Amundi Asset Management, filiale del gruppo Amundi

Obiettivi e politica d'investimento

Il Fondo è un OICVM attivo.

La strategia di investimento del Fondo non è legata a un indice di riferimento, ma le commissioni legate al rendimento sono calcolate rispetto all'indice €STR ("Indice di riferimento"), come indicato nella sezione Commissioni legate al rendimento della categoria del supplemento.

Il Fondo mira a ottenere un apprezzamento del capitale in un orizzonte temporale medio-lungo adottando la strategia Lyxor Epsilon Global Trend. La strategia di investimento del Fondo Lyxor Epsilon Global Trend fornisce un'esposizione a diverse classi di attivi sui mercati globali (azioni, obbligazioni, tassi d'interesse, volatilità

e valute) secondo un processo di investimento basato su un modello sistematico. Tale processo basato su un modello sistematico mira ad attuare una strategia trend following volta a identificare le tendenze al rialzo e al ribasso dei prezzi e a trarne profitto. Tale processo si affida a indicatori quantitativi (tra cui

l'andamento dei prezzi e i segnali di volatilità), combina approcci a medio e lungo termine ed è sottoposto a un continuo miglioramento da parte di un team di ricerca dedicato.

La valuta dell'azione è l'euro (EUR).

- **Strumenti finanziari in cui investe il Comparto:** strumenti derivati finanziari, titoli di debito strutturati, titoli a reddito fisso e strumenti del mercato monetario, depositi di denaro e strumenti liquidi a breve scadenza.
- **Politica dei dividendi:** Il reddito (eventuale) del Fondo non sarà distribuito agli Azionisti, ma reinvestito.
- **Valore patrimoniale netto:** ogni Giorno lavorativo o altro giorno o giorni secondo quanto eventualmente stabilito dagli Amministratori e previamente comunicato agli Azionisti.
- **Rimborsi:** entro le 12:00 (ora irlandese) di ogni Giorno di negoziazione (eccetto stipula contraria da parte degli Amministratori e se previamente comunicato agli Azionisti e in ogni altra occasione precedente il Giorno di valutazione).

Profilo di rischio e di rendimento



La categoria di rischio/rendimento sopra indicata si basa sul livello massimo di rischio che il gestore potrà assumere nell'aderire alla strategia del Fondo, oltre che sul suo rendimento, ove applicabile. Questa stima del rischio può pertanto non costituire un indicatore affidabile del rischio futuro ed essere soggetta a variazioni nel tempo. L'appartenenza alla categoria più bassa non garantisce un investimento esente da rischi.

Il Fondo è stato classificato nella categoria 5. La categoria 5 indica che, in normali condizioni di mercato, è possibile subire una perdita di capitale significativa. Il valore dell'investimento può variare sensibilmente e presentare variazioni giornaliere al rialzo o al ribasso sopra la media.

Principali rischi non compresi nell'indicatore di cui sopra, che potrebbero comportare una diminuzione del valore patrimoniale netto del Fondo e che il Fondo è autorizzato a divulgare nel presente documento (per maggiori informazioni in merito ai rischi, si rimanda alla sezione Profilo di rischio del prospetto):

- **Rischio di controparte:** il Fondo è esposto al rischio di fallimento o a ogni altro tipo di inadempienza di una controparte con cui esso abbia concluso un accordo o un'operazione e, più precisamente, laddove esso abbia sottoscritto strumenti finanziari derivati over-the-counter o effettuato operazioni di prestito titoli. Qualora si verifichi un tale evento, il valore patrimoniale netto del Fondo potrebbe diminuire sensibilmente. Secondo quanto stabilito dal regolamento applicabile al Fondo, tale rischio non può eccedere il 10% del valore patrimoniale totale del Fondo per ciascuna controparte.
- **Rischio relativo agli strumenti finanziari derivati:** il Fondo investe in strumenti finanziari derivati. Tali strumenti finanziari derivati possono comportare diversi tipi di rischio, quali (a titolo esemplificativo e non esaustivo) il rischio legato all'effetto leva, il rischio di elevata volatilità, il rischio di valutazione o il rischio di liquidità. Qualora si verifichi un tale rischio, il valore patrimoniale netto del Fondo potrebbe diminuire sensibilmente.
- **Rischio operativo:** qualora si verifichi un guasto operativo presso la Società di gestione o uno dei suoi rappresentanti, gli investitori potrebbero subire perdite, ritardi nell'elaborazione degli ordini di sottoscrizione, conversione, rimborso o disagi di altra natura.
- **Rischio di credito:** il Fondo è soggetto al rischio di fallimento di qualsiasi emittente o a qualunque altro evento che potrebbe avere un impatto sulla qualità creditizia dell'emittente. Tale rischio o evento potrebbe comportare la riduzione del valore patrimoniale netto del Fondo.

Spese del Fondo

Le spese corrisposte dagli investitori sono utilizzate per coprire i costi di gestione del Fondo, inclusi i costi legati alla commercializzazione e alla distribuzione. Tali spese riducono la crescita potenziale dell'investimento. Per ulteriori informazioni in merito alle spese, si rimanda all'apposita sezione Spese del prospetto del Fondo, disponibile all'indirizzo www.amundi.com.

Spese una tantum prelevate prima o dopo l'investimento

Spesa di sottoscrizione: Fino al 5 %.

Spesa di rimborso: Non applicabile.

Percentuale massima che può essere prelevata dall'impegno di capitale degli investitori prima che esso venga investito e prima che i proventi dell'investimento vengano distribuiti. Sono indicate le spese di sottoscrizione e di rimborso massime. In alcuni casi è possibile pagare importi inferiori. Gli investitori possono informarsi presso i propri consulenti finanziari o distributori in merito alle spese di sottoscrizione e rimborso effettive.

Spese prelevate dal Fondo in un anno

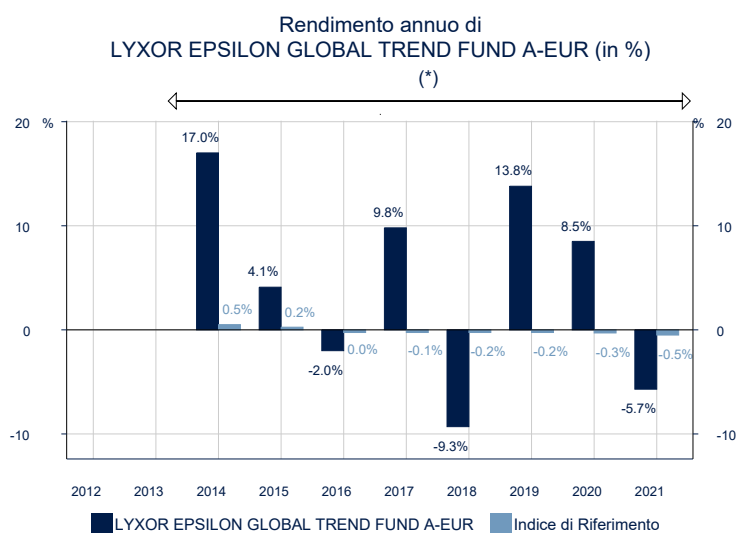
Spese correnti: 1,823 %.

L'importo delle spese correnti si basa sulle spese (incluse le eventuali tasse) dell'anno precedente, conclusosi nel dicembre 2021, e può variare da un anno all'altro. Sono esclusi le commissioni legate al rendimento e il costo delle operazioni di portafoglio, eccetto nel caso di spese di sottoscrizione e di rimborso pagate dal Fondo al momento dell'acquisto o della vendita di quote o azioni di organismi di investimento collettivi sottostanti.

Spese prelevate dal Fondo a determinate condizioni specifiche

Commissioni legate al rendimento: 0,00% per l'anno conclusosi il 31 dicembre 2021. Il 15,00% del rendimento netto del Fondo superiore all'high water mark più la performance dell'Indice di riferimento. Le commissioni legate al rendimento sono cristallizzate al termine di ogni esercizio finanziario. Le commissioni legate al rendimento possono variare da un anno all'altro secondo la formula descritta in precedenza.

Risultati ottenuti nel passato



I risultati passati non costituiscono un'indicazione affidabile dei risultati futuri. Il risultato è indicato in euro (EUR) e al netto di tutte le commissioni a carico del Fondo. Il Fondo è stato costituito in data 31 luglio 2013.

(*) Dal 31 luglio 2013 al 31 dicembre 2021, l'indice di riferimento utilizzato per il confronto delle performance era il tasso composto EURIBOR 1 anno. Dal 1° gennaio 2022, l'Indice di riferimento è il tasso composto €STR.

Informazioni pratiche

■ Banca depositaria: CACEIS Bank Ireland Branch.

Ulteriori informazioni pratiche in relazione al Fondo, l'ultimo prospetto, nonché le ultime relazioni annuali e le relazioni semestrali successive sono disponibili in francese o in inglese, senza costi aggiuntivi, presso il dipartimento di assistenza clienti della Società di gestione, 91-93, boulevard Pasteur, 75015 Parigi, Francia.

Il Fondo è un comparto della Società LYXOR INVESTMENT STRATEGIES PLC. Il prospetto, nonché le ultime relazioni annuali e le relazioni semestrali successive sono redatti per l'intera Società.

Le attività e le passività di ciascun Comparto sono separate per legge (vale a dire che le attività del Fondo non possono essere utilizzate per pagare le passività di altri comparti della Società). Se del caso, le norme in materia di conversioni tra i comparti sono illustrate in dettaglio nel prospetto della Società.

■ Ulteriori informazioni: il valore patrimoniale netto e altre eventuali informazioni sulle categorie di azioni del Fondo sono disponibili su www.amundi.com.

Informazioni su market maker, borse valori e altre informazioni inerenti all'attività di trading sono disponibili alla pagina dedicata al Fondo sul sito web www.amundi.com. Il valore patrimoniale netto indicativo è pubblicato in tempo reale dalla borsa durante le ore di contrattazione.

■ Regime fiscale: la legislazione fiscale in vigore nello Stato membro di origine in cui è registrato il Fondo può avere un impatto sulla posizione fiscale personale degli investitori. Si invitano gli investitori a contattare il proprio consulente fiscale di fiducia per eventuali ulteriori informazioni.

Amundi Asset Management può essere ritenuta responsabile esclusivamente sulla base delle dichiarazioni contenute nel presente documento che risultano fuorvianti, inesatte o incoerenti rispetto alle corrispondenti parti del prospetto del Fondo.

I dettagli della politica aggiornata in materia di remunerazione della Società di gestione sono disponibili all'indirizzo www.amundi.com oppure su richiesta scritta, senza costi aggiuntivi, presso la Società di gestione. Tale politica descrive, in particolare, i metodi di calcolo della remunerazione e delle indennità di determinate categorie di dipendenti, gli organismi responsabili della relativa allocazione e la composizione del Comitato per la remunerazione.

Il Fondo è autorizzato in Irlanda e supervisionato dalla Banca centrale d'Irlanda. Amundi Asset Management è regolamentata dall'Autorité des marchés financiers.

Le informazioni chiave per l'investitore qui presentate sono esatte e aggiornate alla data del 1 giugno 2022.