

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 / Bridgewater All Weather Sustainability Fund - CLASS F EUR (il "Fondo")

ISIN: IE00BMBSC999 - Comparto del veicolo di gestione patrimoniale collettiva irlandese denominato Lyxor Newcits IRL III ICAV (l'"ICAV") con sede in Irlanda. Gestito da Amundi Asset Management, filiale del gruppo Amundi

Obiettivi e politica d'investimento

Il Fondo è un OICVM attivo senza indice di riferimento.

L'obiettivo di investimento del Fondo consiste nel fornire un apprezzamento di capitale a medio e lungo termine, tenendo conto degli obiettivi ambientali, sociali e di governance, prevalentemente mediante l'esposizione a titoli che soddisfano i criteri di sostenibilità del Gestore degli investimenti, rivisti e applicati su base continua.

Il Fondo è gestito attivamente e mira a raggiungere questo obiettivo investendo prevalentemente attraverso posizioni long, ma può di tanto in tanto assumere posizioni short solo a fini di copertura e/o di costruzione del portafoglio.

Le decisioni di investimento saranno prese adottando la strategia di investimento brevettata dal Gestore degli investimenti, che è una strategia di investimento disciplinata, fondamentale e sistematica, basata sulla convinzione che il rendimento delle classi di attivi è trainato principalmente da fattori macroeconomici mutevoli e dalla loro influenza sui mercati. Tenuto conto delle condizioni di mercato, il Gestore degli investimenti prevede che la volatilità a lungo termine (calcolata come la deviazione standard annualizzata dei rendimenti mensili) del Fondo potrebbe essere all'incirca dell'8%.

Il Fondo perseguirà tale obiettivo finanziario tenendo conto degli obiettivi ambientali, sociali e di governance, rimanendo principalmente esposto a titoli che rispettano gli Obiettivi per lo sviluppo sostenibile delle Nazioni Unite (SDG), una serie di obiettivi globali volti a generare un impatto ambientale, sociale e di governance positivo.

Il Gestore degli investimenti ha brevettato una metodologia che permette di determinare in che misura un titolo rispetta gli SDG. All'interno di ogni classe di attivi, i titoli che rispettano maggiormente gli SDG sono selezionati per costituire un universo di titoli sostenibili, indipendentemente dal loro settore di attività (altrimenti detto approccio "best-in-universe").

I limiti principali dell'approccio extra-finanziario utilizzato dal Fondo consistono nell'affidamento su dati di terzi e nella completezza della mitigazione del rischio di sostenibilità. Ulteriori informazioni in relazione a tali limiti sono disponibili nel supplemento al Fondo.

La valuta dell'azione è l'euro (EUR).

- **Strumenti finanziari in cui investe il Fondo:** azioni, strumenti di debito, obbligazioni indicizzate all'inflazione, exchange traded commodity, quote di ETF e fondi del mercato monetario, e strumenti finanziari derivati (quali future, forward, swap su tassi d'interesse, CDS, swap sull'inflazione, total return swap).
- **Politica dei dividendi:** Il reddito (eventuale) del Fondo non sarà distribuito agli Azionisti, ma reinvestito.
- **Valore patrimoniale netto:** è calcolato giornalmente, a condizione che le borse valori di pertinenza siano aperte per la negoziazione e sia possibile eseguire gli ordini.
- **Rimborsi:** alle 13:00, ora irlandese, del giorno di apertura precedente il Giorno di valutazione, oppure a un orario diverso eventualmente stabilito dagli Amministratori e previamente comunicato agli Azionisti.

Profilo di rischio e di rendimento



La categoria di rischio/rendimento sopra indicata si basa sul livello massimo di rischio che il Gestore degli investimenti 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 4. La categoria 4 indica che, in normali condizioni di mercato, è possibile subire una perdita di capitale di modesta entità. Il valore dell'investimento può registrare variazioni giornaliere moderate o lievi al rialzo o al ribasso.

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 inadempimento 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 liquidità:** In determinate circostanze, ad esempio nel caso di volumi commerciali ridotti sui mercati finanziari, qualsiasi attività di acquisizione o vendita relativa a strumenti finanziari detenuti dal Fondo o che ne influenzano il valore, potrebbe comportare variazioni significative delle loro valutazioni. In circostanze simili, il valore patrimoniale netto del Fondo potrebbe risentirne negativamente.
- **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:	Fino al 3%.
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:	0,70 %.
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:	non applicabile.

Risultati ottenuti nel passato

Rendimento annuo di
LYXOR / Bridgewater All Weather Sustainability Fund - CLASS F EUR (in %)

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 30 aprile 2021.

- I dati non sono sufficienti a fornire agli investitori del Fondo un'indicazione utile per i risultati ottenuti nel passato. -

Informazioni pratiche

■ **Depositario:** Société Générale SA, filiale di Dublino.

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 del Gestore, 91-93, boulevard Pasteur, 75015 Parigi, Francia. Il Fondo è un comparto della Società Lyxor Newcits IRL III ICAV. 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.