

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 l'investitore 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 I-EUR (il "Fondo")

ISIN: IE00B643RZ01 - Comparto della società di investimento denominata LYXOR INVESTMENT STRATEGIES PLC (la "Società") con sede in Irlanda.
Gestito da Lyxor Asset Management S.A.S. ("LAM")

Obiettivi e politica di investimento

Questo Fondo è un OICVM attivo. La strategia di investimento del Fondo non è legata a un indice di riferimento ma la commissione legata al rendimento è calcolata rispetto all'indice EURIBOR 1 year (l'"Indice di riferimento"), come indicato nella sezione del supplemento dedicata alle Commissioni legate al rendimento.

Il Fondo mira a ottenere un apprezzamento del capitale in un orizzonte temporale medio-lungo applicando la strategia Lyxor Epsilon Global Trend. La strategia di investimento di Lyxor Epsilon

Global Trend Fund fornisce un'esposizione a diverse classi di attivi sui mercati globali (azioni, obbligazioni, tassi d'interesse, volatilità e valute) secondo un modello sistematico basato sul processo di investimento. Tale processo basato su un modello sistematico punta all'attuazione di una strategia

che segua le tendenze per identificare le tendenze al rialzo e al ribasso dei prezzi e capitalizzare su di esse. Tale processo si affida a segnali quantitativi (tra cui il momentum del prezzo e segnali di volatilità), unisce un approccio a medio e lungo termine ed è sottoposto a un continuo miglioramento da parte di un team di ricerca dedicato.

La valuta delle quote 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 dettagli sui rischi, si invita a consultare la sezione Profilo di rischio del Prospetto informativo):

- **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 particolare, laddove esso abbia sottoscritto strumenti derivati finanziari 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 derivati finanziari:** Il Fondo investe in strumenti derivati finanziari. Tali strumenti derivati finanziari possono comportare diversi tipi di rischio come (a titolo esemplificativo ma non esaustivo), rischio di leva elevato rischio di volatilità, rischio di valutazione o 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 vengono 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 prega di consultare l'apposita sezione Spese del prospetto informativo del Fondo, disponibile all'indirizzo www.lyxorfunds.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: 1.14 %

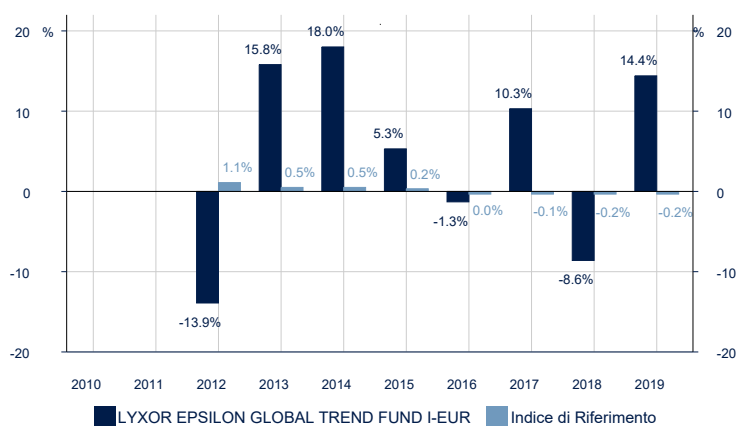
Per l'anno conclusosi nel dicembre 2019, i dati sulle spese correnti sono basati sulle spese dell'anno precedente (incluse le eventuali tasse) e possono variare di anno in anno. Sono escluse le commissioni legate al rendimento e i costi relativi alla transazione del portafoglio, eccetto nel caso delle spese di sottoscrizione e di rimborso pagate dal Fondo al momento dell'acquisto o della vendita di quote o azioni di investimenti collettivi di capitale sottostanti.

Spese prelevate dal Fondo a determinate condizioni specifiche

Commissioni legate al rendimento: 1,12% per l'anno conclusosi il 31 dicembre 2019. La commissione di performance della classe si eleva al 15% dell'apprezzamento del NAV netto realizzato e non realizzato.

Risultati ottenuti nel passato

Rendimento annuo di
LYXOR EPSILON GLOBAL TREND FUND I-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 15 aprile 2011.

Informazioni pratiche

- **Banca depositaria:** CACEIS Bank Ireland Branch.

Ulteriori informazioni pratiche in relazione al Fondo, l'ultimo Prospetto informativo, nonché le ultime relazioni annuali e qualsiasi successiva relazione semestrale sono disponibili in lingua francese o in lingua inglese, senza costi aggiuntivi, presso il dipartimento di assistenza clienti della Società di gestione, 17, Cours Valmy, Tour Société Générale 92800 Puteaux, FRANCIA.

- **Informazioni supplementari:** il valore patrimoniale netto e altre (eventuali) informazioni sulle categorie di azioni del Fondo sono disponibili all'indirizzo www.lyxorfunds.com.

- **Regime fiscale:** la legislazione fiscale in vigore nello Stato membro d'origine in cui è registrato il Fondo può incidere sulla posizione fiscale personale degli investitori. Si invita l'investitore a contattare il proprio consulente fiscale di fiducia per eventuali ulteriori informazioni.

Lyxor 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 informativo del Fondo.

I dettagli della politica aggiornata in materia di remunerazione della Società di gestione sono disponibili all'indirizzo www.lyxor.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 Central Bank of Ireland. Lyxor Asset Management è regolamentata dall'Autorité des marchés financiers.

Le informazioni chiave per l'investitore qui presentate sono esatte e aggiornate alla data del 23 settembre 2020.