

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 Conservative Allocation Class M (EUR) (il "Fondo")

ISIN: LU0539466663 - Comparto della società di investimento denominata LYXOR INVESTMENT FUNDS (la "Società") con sede in Lussemburgo.
Gestito da Lyxor Asset Management S.A.S. ("LAM")

Obiettivi e politica di investimento

Questo Fondo è un OICVM attivo.

L'obiettivo di investimento del Fondo consiste nel fornire un apprezzamento del capitale netto (tenendo conto di tutte le commissioni e le spese attribuibili al Fondo) superiore all'indice EONIA (l'"Indice di riferimento") o al tasso del mercato monetario equivalente nella relativa valuta della Classe di azioni, su un orizzonte da 3 a 5 anni, mantenendo il livello della volatilità annua inferiore all'3%. La maggior parte degli investimenti o delle esposizioni del Fondo non è legata all'Indice di riferimento. La strategia di investimento del Fondo può discostarsi notevolmente dall'Indice di riferimento.

Il Fondo ha un approccio di investimento flessibile per generare performance nella maggior parte degli scenari di mercato. Investirà pertanto in un portafoglio diversificato di strumenti liquidi.

La valuta delle quote è l'euro (EUR).

- **Strumenti finanziari in cui investe il Fondo:** attivi idonei, tra cui, a titolo esemplificativo, azioni, obbligazioni, Exchange Traded Fund, OICVM, strumenti del mercato monetario, titoli con derivati integrati e strumenti derivati (quali future quotati, opzioni quotate, forward e swap legati ad esempio ad azioni, obbligazioni, valute, indici su materie prime e tassi di interesse).
- **Politica dei dividendi:** Il reddito (eventuale) del Fondo non sarà distribuito agli Azionisti, ma reinvestito.
- **Valore patrimoniale netto:**
Il Valore patrimoniale netto per azione è calcolato in ogni Giorno di valutazione, ovvero (i) ogni giorno lavorativo completo di normale attività delle banche in Lussemburgo, a New York e a Parigi, e (ii) di regolare svolgimento delle sessioni di negoziazione delle borse valori negli Stati Uniti, nell'Unione europea e nel Regno Unito, salvo altre disposizioni del Consiglio di amministrazione.
- **Rimborsi:** Le richieste di rimborso di Azioni devono indicare il numero di Azioni e dovranno essere centralizzate dal Conservatore del registro entro le ore 12:00 (ora di Lussemburgo), ogni Giorno di valutazione (come definito di seguito) e trattate al Valore patrimoniale netto calcolato in tale Giorno di valutazione. Le richieste di rimborso inviate dopo le ore 12:00 (ora di Lussemburgo) del Giorno di valutazione saranno considerate come ricevute prima delle ore 12:00 (ora di Lussemburgo) del Giorno di valutazione successivo.

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 3. La categoria 3 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 molto 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 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 1%.

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. 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: 1,45 %.

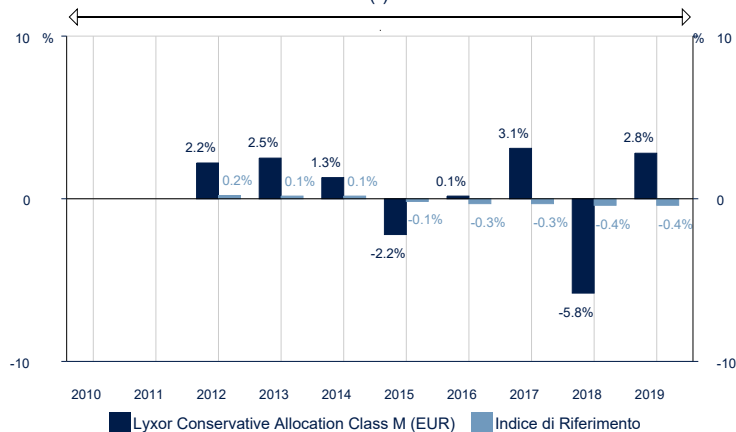
Per l'anno conclusosi nel dicembre 2019, il dato sul tasso delle spese correnti è basato sul tasso dell'anno precedente (incluse le eventuali tasse) e può variare di anno in anno. Sono escluse le commissioni legate al rendimento e i costi relativi alla transazione del portafoglio, eccetto nel caso delle 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: Fino al 10% annuo per ogni rendimento positivo superiore all'hurdle (che corrisponde all'Indice di riferimento). Commissione legata al rendimento versata al Fondo nell'esercizio finanziario precedente: 0,00%.

Risultati ottenuti nel passato

Rendimento annuo di
Lyxor Conservative Allocation Class M (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 26 settembre 2011.

(*) L'Indice benchmark di riferimento del Fondo è EONIA.

Informazioni pratiche

■ Banca depositaria: Société Générale Luxembourg.

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.

Il Fondo è un comparto della Società LYXOR INVESTMENT FUNDS. Il Prospetto informativo, nonché le ultime relazioni annuali e qualsiasi successiva relazione semestrale 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). Laddove applicabile, le norme in materia di conversione tra i comparti sono illustrate in dettaglio nel Prospetto informativo della Società.

■ 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 Lussemburgo e supervisionato dalla Commission de surveillance du secteur financier. 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 15 dicembre 2020.