

# DATOS FUNDAMENTALES PARA EL INVERSOR

El presente documento recoge los datos fundamentales sobre este fondo que el inversor debe conocer. No se trata de material promocional. La ley exige que se le facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del fondo y los riesgos que comporta invertir en él. Le recomendamos que la lea para que, de esta manera, pueda tomar una decisión fundada sobre la inversión.

## LYXOR EPSILON GLOBAL TREND FUND I-EUR (el "Fondo")

ISIN: IE00B643RZ01 - Un subfondo de la sociedad de inversión denominada LYXOR INVESTMENT STRATEGIES PLC (en lo sucesivo, la "Sociedad"), domiciliada en Irlanda.

Gestionado por Lyxor Asset Management S.A.S. ("LAM")

## Objetivos y política de inversión

El Fondo es un OICVM activo. La estrategia de inversión del Fondo no sigue ningún índice de referencia, pero las comisiones de rentabilidad se calculan en base al EURIBOR 1 year (en lo sucesivo, el "Índice de referencia"), tal y como define la sección Comisión de rentabilidad de la clase del suplemento.

El Fondo pretende conseguir la revalorización del capital de medio a largo plazo aplicando la estrategia Lyxor Epsilon Global Trend. La estrategia de inversión Lyxor Epsilon

Global Trend Fund ofrece exposición a varias clases de activos de los mercados mundiales (incluyendo renta variable, renta fija, tipos de interés, volatilidad y divisas), según un proceso de inversión sistemático basado en un modelo. El objetivo de dicho proceso sistemático basado en un modelo es aplicar una estrategia que siga las tendencias con el fin de detectar tendencias al alza o a la baja de los precios y aprovecharlas. Dicho proceso se basa en indicios cuantitativos (como, por ejemplo, los indicios de dinámica de precios y volatilidad), combina enfoques a medio y largo plazo y es objeto de continuas mejoras por parte de un equipo de análisis específico.

La moneda de la acción es el euro (EUR).

- **Instrumentos financieros en los que se invierte:** Instrumentos financieros derivados, instrumentos de deuda estructurados, valores de renta fija e instrumentos del mercado monetario, depósitos en efectivo e instrumentos de cuasi efectivo.
- **Política de dividendos:** todos los importes del Fondo disponibles para distribución (en caso de haberlos) no se distribuirán a los Accionistas, sino que serán reinvertidos.
- **Valor liquidativo:** Cada Día Hábil o cualquier otro día o días que determine el Consejo y se notifique a los Accionistas previamente.
- **Reembolso:** 12:00 (hora de Irlanda) de cualquier Día de Operaciones (u otro día que determine el Consejo y se notifique a los Accionistas, siempre con antelación al Día de Valoración).

## Perfil de riesgo y remuneración



El perfil de riesgo/remuneración mostrado anteriormente se basa en el nivel máximo de riesgo que el gestor podría asumir en la implantación de la estrategia del Fondo, así como en sus resultados, según proceda. Por consiguiente, es posible que la estimación del riesgo no constituya un indicador fiable del riesgo futuro y esté sujeta a variación a lo largo del tiempo. La asignación a la categoría más baja no significa que la inversión esté libre de riesgo.

El Fondo ha sido clasificado dentro de la categoría 5. La categoría 5 indica que, en condiciones normales de mercado, es posible que se dé una pérdida considerable de capital; el valor de su inversión podrá fluctuar de manera notable y sufrir variaciones diarias superiores a la media, tanto al alza como a la baja.

Principales riesgos no cubiertos por el indicador anterior que podrían llevar a un descenso del valor liquidativo del Fondo y sobre los que el Fondo está autorizado a informar en el presente documento (para más información sobre los riesgos, consulte la sección de Perfil de Riesgo del folleto):

- **Riesgo de contraparte:** El Fondo está expuesto al riesgo de que cualquier contraparte con la que haya formalizado un contrato o transacción pueda declararse insolvente o en otra situación de impago y, más concretamente, en la ejecución de instrumentos financieros derivados extrabursátiles u operaciones de préstamo de valores. Si se produce tal suceso, el valor liquidativo del Fondo puede disminuir significativamente. Según el reglamento aplicable al Fondo, este riesgo no puede superar el 10 % de los activos totales del Fondo por contraparte.
- **Riesgo de instrumentos financieros derivados:** El Fondo invierte en instrumentos financieros derivados. Estos instrumentos financieros derivados pueden llevar aparejados diferentes tipos de riesgos, por ejemplo (sin carácter restrictivo) el riesgo de apalancamiento el riesgo de volatilidad elevada, el riesgo de valoración o el riesgo de liquidez. Si se materializa alguno de estos riesgos, el valor liquidativo del Fondo puede disminuir significativamente.
- **Riesgo operativo:** En caso de fallo operativo en la sociedad de gestión o uno de sus representantes, los inversores podrían sufrir pérdidas, retrasos en la tramitación de las suscripciones, conversiones, órdenes de reembolso u otras molestias.
- **Riesgo de crédito:** El Fondo está expuesto al riesgo de que cualquier emisor pueda declararse insolvente o a cualquier otra situación que pueda afectar a la calidad crediticia de dicho emisor. Este riesgo o situación podría generar un descenso del valor liquidativo del Fondo.

## Gastos del Fondo

Los gastos que usted soporta están destinados a sufragar los costes de gestión del Subfondo, incluidos los de comercialización y distribución. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de su inversión. Si desea más información sobre los gastos, consulte la sección de gastos correspondiente del folleto del Fondo que se encuentra disponible en [www.lyxorfunds.com](http://www.lyxorfunds.com).

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión

**Gastos de entrada:** Hasta el 5 %.

**Gastos de salida:** No aplicable.

Este es el máximo que puede detrarse de su capital antes de proceder a la inversión y antes de abonar el producto de la inversión. Los gastos de entrada y salida que se muestran son el valor máximo, por lo que, en algunos casos, podría tener que pagar menos. Los inversores pueden obtener información acerca de los gastos efectivos de entrada y salida a través de su asesor financiero o distribuidor.

Gastos detrados del Fondo a lo largo de un año.

**Gastos corrientes:** 1.14 %

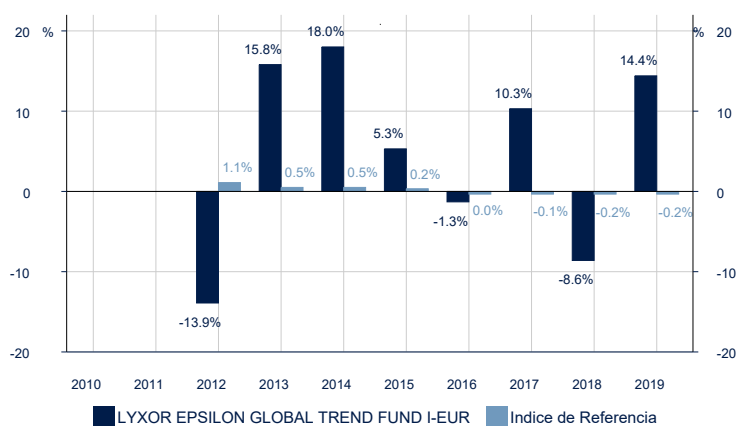
La cifra de gastos corrientes se basa en los gastos del año pasado (incluidos impuestos, si procede) para el ejercicio cerrado en diciembre de 2019, y podría variar de un año a otro. No incluye las comisiones de rentabilidad ni los costes de operación de la cartera, salvo en caso de que el Fondo haya abonado un gasto de entrada/salida al comprar o vender participaciones o acciones de instituciones de inversión colectiva subyacentes.

Gastos detrados del Fondo en determinadas condiciones específicas

**Comisión de rentabilidad:** 1,12 % para el ejercicio cerrado el 31 de diciembre de 2019. La comisión de rentabilidad de la clase corresponde al 15 % de la revalorización neta realizada y no realizada del valor liquidativo.

## Rentabilidad histórica

Rentabilidad anual del  
LYXOR EPSILON GLOBAL TREND FUND I-EUR (en %)



La rentabilidad histórica no es un indicador fiable de la rentabilidad futura. La rentabilidad se indica en euros (EUR) y libre de todas las comisiones que deba sufragar el Fondo. El Fondo se constituyó el 15 de abril de 2011.

## Información práctica

- **Depositario:** CACEIS Bank Ireland Branch.

Dispone de otra información práctica sobre el Fondo, la última versión del folleto y los últimos informes anuales, así como cualquier informe semestral posterior (en francés o inglés) de forma gratuita a través del departamento de atención al cliente de la sociedad gestora, en la dirección 17, Cours de Valmy, Tour Société Générale 92800 Puteaux, FRANCIA.

- **Información adicional:** el valor liquidativo y otra información sobre las clases de participaciones (en su caso) están disponibles en [www.lyxorfunds.com](http://www.lyxorfunds.com).

- **Fiscalidad:** la legislación fiscal aplicable en el Estado miembro en que el Fondo esté registrado puede afectar a los inversores. Póngase en contacto con su asesor fiscal habitual para obtener información adicional.

Lyxor Asset Management únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto del Fondo.

La información detallada sobre la política de remuneración actualizada de la sociedad gestora puede consultarse en [www.lyxor.com](http://www.lyxor.com) o sin coste alguno previa solicitud por escrito a la sociedad gestora. Esta política describe, en particular, los métodos de cálculo de la remuneración y los beneficios de determinadas categorías de empleados, los organismos encargados de su asignación y la composición del Comité de remuneración.

El Fondo está autorizado en Irlanda y supervisado por el Banco Central de Irlanda. Lyxor International Asset Management está regulada por la Autoridad de los Mercados Financieros francesa (Autorité des Marchés Financiers, AMF).

Los presentes datos fundamentales para el inversor son exactos y están actualizados a 23 septiembre 2020.