

DOCUMENTO PER LA QUOTAZIONE

Offerente

LYXOR INDEX FUND

(la "Società") società di investimento a capitale variabile di diritto lussemburghese di tipo multicomparto costituita ed operante in conformità alla Direttiva n. 2009/65/CE e successive modifiche

Soggetto Incaricato della Gestione: **Lyxor International Asset Management**

Ammissione alle negoziazioni del Comparto della Società denominato:

Denominazione	Classe e Valuta	ISIN
Lyxor Index Fund - Lyxor MSCI World Catholic Principles ESG (DR) UCITS ETF	Acc - USD	LU2216829809

avente le caratteristiche di ETF indicizzato di diritto lussemburghese

Data di deposito in CONSOB della Copertina: 29 settembre 2020

Data di validità della Copertina: 30 settembre 2020

La pubblicazione del presente Documento non comporta alcun giudizio della CONSOB sull'opportunità dell'investimento proposto. Il presente Documento è parte integrante e necessaria del Prospetto.

DOCUMENTO PER LA QUOTAZIONE

Relativo al Comparto

Denominazione	Classe e Valuta	ISIN
Lyxor Index Fund - Lyxor MSCI World Catholic Principles ESG (DR) UCITS ETF	Acc - USD	LU2216829809

della

LYXOR INDEX FUND

Soggetto Incaricato della Gestione: **Lyxor International Asset Management**

Data di deposito in CONSOB del Documento per la Quotazione: 29 settembre 2020

Data di validità del Documento per la Quotazione: dal 30 settembre 2020

A) INFORMAZIONI GENERALI RELATIVE ALL'AMMISSIONE ALLE NEGOZIAZIONI**1. Premessa e descrizione sintetica dell'OICR***Presentazione dell'OICR e caratteristiche degli ETF*

La LYXOR INDEX FUND (di seguito, la "Società"), con sede legale in 28-32 Place de la Gare, L-1616, Lussemburgo, è una società di investimento a capitale variabile di tipo aperto di diritto lussemburghese, qualificata come organismo di investimento collettivo del risparmio (definito "OICR") armonizzato ai sensi della Direttiva 2009/65/CE in materia di organismi di investimento collettivo in valori mobiliari, e successive modifiche.

Il soggetto incaricato della gestione è Lyxor International Asset Management con sede legale in 17 Cours Valmy, 92987 Parigi La Défense, società di gestione di diritto francese autorizzata dalla *Autorité des Marchés Financiers* al numero GP04024.

La Società è strutturata in comparti, nel senso che il suo capitale azionario è diviso in vari gruppi di azioni (di seguito, le "Azioni"), ognuno rappresentante un distinto comparto di investimento della Società. Il comparto della Società descritto nel presente Documento è definito il "Comparto", e i comparti della Società quotati in Italia sono congiuntamente definiti i "Comparti".

Le principali caratteristiche dei Comparti ne consentono la quotazione e la negoziazione delle parti presso i mercati regolamentati (c.d. "mercato secondario"), nei quali tutti gli investitori avranno la possibilità di acquistare le azioni dei Comparti messe in vendita, tra gli altri, dagli operatori istituzionali che, a loro volta, hanno sottoscritto direttamente presso l'emittente (c.d. "mercato primario") elevate quantità di azioni dei Comparti. In Italia, gli investitori *retail* (diversi cioè dagli "investitori qualificati" di cui all'articolo 100, comma 1, lett. a) del D. Lgs. 24 febbraio 1998, n. 58, come definiti all'articolo 34-ter del Regolamento CONSOB n. 11971 del 1999 in materia di Emittenti) potranno acquistare e vendere Azioni dei Comparti esclusivamente sul "mercato secondario", come sopra definito.

Obiettivo di investimento del Comparto – Indice - Tracking error previsto

L'obiettivo di investimento del Comparto è di replicare il rendimento del proprio indice di riferimento. Ciò avviene mediante una replica "diretta", come più sotto descritta nel paragrafo *"Modalità di replica dell'Indice"*.

Tale indice (l'"Indice"), unitamente al fornitore (*index provider*) e codice identificativo (*ticker*), sono indicati qui di seguito:

Indice	Index Provider	Ticker Bloomberg dell'Indice
MSCI World Select Catholic Principles ESG Universal and Environment Net Total Return Index	MSCI	MXWOCATH Index

L'indice è versione Net Total Return.

Ci si aspetta che in condizioni normali di mercato il **tracking error** previsto sia fino allo 0,50%.

Non è attualmente previsto, per il perseguimento dell'obiettivo di investimento, il ricorso ad operazioni di *securities lending* o *repurchase agreement*. Tuttavia, si segnala che, qualora

la Società dovesse farvi ricorso, i proventi eventualmente conseguiti saranno accreditati ai Comparti stessi detratte le commissioni del gestore e del soggetto intermediario (e cioè il *Securities Lending Agent*), secondo quanto disposto nella sezione *Securities Lending and Borrowing Transactions* dell'Appendice B – Investment Techniques del Prospetto.

Il Comparto potrebbe non essere adatto agli investitori con un orizzonte temporale di investimento inferiore a cinque anni.

Descrizione dell'Indice

L'Indice è concepito per misurare il rendimento di una strategia che mira a selezionare delle società con emissioni di carbonio più basse e un profilo ESG (*Environmental, Social, Governance*) migliore rispetto alla media dell'indice MSCI World Index (l'"Indice di Base"), escludendo anche le società attive in settori controversi come armi, gioco d'azzardo e intrattenimento per adulti. Sono inoltre escluse dall'Indice le società con attività connesse ad aborto e contraccezione, ricerche sulle cellule staminali e sperimentazioni su animali.

Per essere idonee all'inclusione nell'Indice, le società devono rispettare i seguenti requisiti:

- rientrare nell'universo di investimento dell'Indice di Base (azioni di società a grande e media capitalizzazione dei Paesi sviluppati);
- avere un rating ESG minimo di "BB" attribuito da MSCI;
- non essere coinvolte in gravi controversie in materie ESG, secondo i criteri del "punteggio delle controversie in materie ESG" ("*ESG Controversies score*") attribuito da MSCI;
- non operare in settori come armi controverse, armi nucleari, gioco d'azzardo, intrattenimento per adulti, nonché cellule staminali, aborto e contraccezione e sperimentazioni su animali.

I titoli che rispettano i suddetti requisiti costituiscono i "Titoli Idonei".

I Titoli Idonei vengono poi: (i) classificati in termini di intensità di emissioni di carbonio (usando una metodologia di MSCI) ed escludendo il 20% dei Titoli Idonei con la più elevata intensità di emissioni di carbonio, e (ii) classificati in base alle emissioni potenziali di carbonio derivanti da combustibili fossili per dollaro di capitalizzazione; i titoli vengono esclusi fino a quando la somma delle emissioni potenziali di carbonio derivanti da combustibili fossili dei titoli esclusi raggiunge il 50% del totale delle emissioni potenziali di carbonio derivanti da combustibili fossili di tutti i Titoli Idonei. Le esclusioni di cui ai punti (i) e (ii) sono applicate indipendentemente l'una dall'altra.

I Titoli Idonei rimasti concorrono a formare l'Indice sulla base della loro ponderazione all'interno dell'Indice di Base corretta per i rispettivi Punteggi ESG Totali ("*Combined ESG Score*") come assegnati da MSCI secondo criteri che tengono conto del profilo ESG dell'impresa e delle tendenze di tale profilo.

L'Indice è rivisto su base trimestrale.

La metodologia completa dell'Indice e la relativa composizione sono disponibili nel sito dell'Index Provider: www.msci.com

Ulteriori informazioni sull'Indice oltre a quelle sopra riportate sono disponibili nella sezione intitolata "*The Index*" e "*Index composition and revision*" dell'Appendice al Prospetto relativa al Comparto.

Modalità di replica dell'Indice

La modalità di replica dell'Indice da parte del Comparto è quella diretta, definita "*Direct Replication*" e descritta nella sezione "*Investment Objectives and Policies*" del Prospetto, consistente nell'acquisizione dei titoli dell'Indice; la società di gestione può altresì usare una replica "a campione" (in inglese, "*sampling*"), consistente nell'acquisto di una selezione rappresentativa delle componenti dell'Indice.

L'esposizione del Comparto è calcolata con il metodo degli impegni. Il Comparto non fa uso della leva finanziaria.

2. Rischi

I potenziali investitori sono invitati a verificare i profili di rischio qui di seguito indicati. Si prega altresì di fare riferimento alla Appendix C del Prospetto intitolata "*Special Risk Considerations and Risk Factors*" del Prospetto, ai tre profili di rischio indicati nella sezione "*Principal risks*" dell'Appendice al Prospetto relativa al Comparto ed alla sezione del KIID sui rischi.

Rischio di investimento

Gli obiettivi e la politica di investimento di un Comparto consistono nel perseguire dei rendimenti che, al lordo delle spese, corrispondano in via generale alla prestazione del suo Indice. Tuttavia, non è possibile garantire l'effettivo perseguimento dei suddetti obiettivi ovvero la replica del rispettivo Indice a causa – tra l'altro - dei seguenti fattori:

- un Comparto deve sostenere alcune spese, a differenza del rispettivo indice che non ne risente;
- un Comparto deve effettuare i propri investimenti in conformità alle regolamentazioni applicabili, che invece non incidono sulla formazione del rispettivo indice;
- la differente tempistica tra un Comparto ed il relativo Indice rispetto al momento a cui vengono imputati i dividendi.

La performance delle Azioni di un Comparto negoziate nei mercati regolamentati potrebbe quindi non riflettere esattamente quella del relativo Indice.

Rischio indice

Non vi è garanzia che un Indice continui ad essere calcolato e pubblicato. Nel caso in cui l'Indice cessi di essere calcolato o pubblicato, esiste il diritto dell'investitore a chiedere il rimborso delle proprie Azioni a valere sul patrimonio del Comparto rilevante, con le modalità indicate nel paragrafo 4.

Rischio di sospensione temporanea della valorizzazione delle Azioni dei Comparti

La Società può sospendere temporaneamente il calcolo del Valore del Patrimonio Netto (NAV) per Azione e la sottoscrizione, la conversione e il riscatto delle Azioni di uno o più Comparti nelle circostanze indicate nella sezione "*Temporary Suspension of the Net Asset Value Calculation*" del Prospetto. Salvo il diritto dell'investitore al rimborso delle Azioni in determinate circostanze (si veda il paragrafo 4), la Società può procedere al rimborso coattivo dell'insieme delle Azioni di un Comparto nei casi indicati nel capitolo "*Redemption of Shares on Primary Market*" del Prospetto.

Rischio connesso alla liquidazione anticipata dei Comparti

La Società ed i suoi Comparti possono essere soggetti a liquidazione anticipata nei casi rispettivamente previsti dai paragrafi "*Dissolution and Liquidation of the Company*" e "*Termination of Sub-Funds or Classes of Shares*" della sezione "*Termination of the Company*" del Prospetto, ed in tale evento vi è il rischio che l'investitore riceva un

corrispettivo per le Azioni dei Comparti detenute inferiore a quello che avrebbe ottenuto se avesse avuto la possibilità di decidere autonomamente quando vendere tali Azioni.

Rischio di cambio

Dal momento che la valuta di trattazione su Borsa Italiana delle Azioni del Comparto è l'Euro e che l'Indice è denominato in Dollari USA (USD) e comprende titoli denominati in USD ed altre valute locali, gli investitori saranno esposti al rischio di cambio tra l'Euro e il Dollaro USA e tra l'Euro e le suddette altre valute.

Rischio azionario

Il Comparto è esposto al rischio di mercato connesso all'andamento dei titoli azionari che compongono il suo portafoglio. Le oscillazioni dei mercati azionari possono determinare variazioni significative del patrimonio netto del Comparto, che possono incidere negativamente sul NAV. Il Comparto è esposti fino al 100% al rischio azionario e il suo NAV può quindi subire ribassi significativi.

Le Azioni dei Comparti possono essere acquistate da tutti gli investitori sul mercato di quotazione - indicato nel paragrafo successivo - attraverso intermediari autorizzati (nel seguito, "Intermediari Autorizzati"). Restano fermi per questi ultimi gli obblighi di rendicontazione di cui agli articoli 51 e 60 del Regolamento CONSOB n. 20307 del 2018 in materia di Intermediari e successive modifiche.

3. Avvio delle negoziazioni

Con provvedimento n. LOL-004300 del 17 settembre 2020, Borsa Italiana S.p.A. ha disposto l'ammissione a quotazione delle Azioni del Comparto nel mercato di Borsa Italiana, comparto ETFplus, "segmento ETF indicizzati – Classe 2", demandando ad un successivo Avviso la data di inizio delle negoziazioni.

4. Negoziabilità delle Azioni e informazioni sulle modalità di rimborso

La negoziazione delle Azioni si svolgerà, nel rispetto della normativa vigente, nel mercato ETFplus, "segmento ETF indicizzati – Classe 2", dalle 8:45 alle 9:04 in asta di apertura, dalle 9:04 alle 17:30 in negoziazione continua e dalle 17:30 alle 17:35 in asta di chiusura, consentendo agli investitori di acquistare e vendere le Azioni tramite gli Intermediari Autorizzati.

Le Azioni acquistate sul mercato secondario non possono di regola essere rimborsate a valore sul patrimonio dei rispettivi Comparti, salvo che non ricorrano le situazioni di seguito specificate. In particolare, in conformità a quanto stabilito dall'articolo 19-*quater* del Regolamento CONSOB n. 11971 del 1999 in materia di Emittenti, ove il prezzo di mercato presenti uno scostamento significativo rispetto al valore patrimoniale netto per Azione, l'investitore avrà titolo a ottenere il rimborso della propria partecipazione a valore sul patrimonio del Comparto di pertinenza. Si prega di fare riferimento alla sezione "*Redemption of shares on primary market*" del Prospetto per informazioni sulle modalità di rimborso sul mercato primario. In particolare, qualora si verificano le sopra descritte condizioni di scostamento significativo che rendono possibile il rimborso diretto delle Azioni, la Società diffonderà un apposito Avviso di Borsa e gli investitori al dettaglio italiani che hanno acquistato le Azioni sul mercato secondario si avvarranno, per l'inoltro dei relativi ordini di rimborso, degli Intermediari Autorizzati. Gli oneri di rimborso per i Comparti sono indicati nella sezione "*Summary table of Shares issued by the Company*" dell'Appendice E al Prospetto; si precisa che le commissioni ivi indicate sono dei massimi, e che la Società può accordare delle riduzioni.

Oltre alle informazioni indicate nel paragrafo 10 del presente Documento, la Società comunicherà a Borsa Italiana entro le ore 11:00 (ora italiana) di ciascun giorno di borsa aperta, le seguenti informazioni per i Comparti, relative al giorno di borsa aperta precedente:

- il valore del patrimonio netto (NAV) dei Comparti; e
- il numero di Azioni in circolazione.

La Società mette a disposizione del pubblico nel sito www.lyxoretf.it ed eventualmente presso altri siti e/o information provider le seguenti informazioni ed i relativi aggiornamenti:

- il valore dell'iNAV del Comparto su base continuativa.

Il NAV per Azione di cui sopra è pubblicato anche nel sito Internet della Società all'indirizzo: www.etf.it e sul sito Internet di Borsa Italiana all'indirizzo www.borsaitaliana.it

La Società informa senza indugio il pubblico dei fatti che riguardano i Comparti, non di pubblico dominio e idonei, se resi pubblici, a influenzare sensibilmente il prezzo delle Azioni, mediante invio del comunicato di cui all'articolo 66 del Regolamento CONSOB n. 11971 del 1999 in materia di Emittenti e successive modifiche.

Alla data del presente Documento, le Azioni del Comparto non sono quotate in altri mercati regolamentati.

La Società si riserva la facoltà di presentare istanza per l'ammissione alle negoziazioni del Comparto presso altre piazze finanziarie.

5. Operazioni di acquisto/vendita mediante tecniche di comunicazione a distanza

L'acquisto e la vendita delle Azioni possono aver luogo anche mediante "tecniche di comunicazione a distanza" (Internet), avvalendosi delle piattaforme informatiche degli Intermediari Autorizzati, nel rispetto delle disposizioni di legge e regolamentari vigenti. A tal fine, gli Intermediari Autorizzati possono attivare servizi "on line" che, previa identificazione dell'investitore e rilascio di password e codice identificativo, consentono allo stesso di impartire richieste di acquisto/vendita via Internet in condizioni di piena consapevolezza. La descrizione delle specifiche procedure da seguire è riportata nei siti operativi.

L'Intermediario Autorizzato rilascia all'investitore idonea attestazione dell'avvenuta operazione realizzata tramite Internet, con possibilità di acquisire tale attestazione su supporto duraturo. Anche in caso di acquisti/vendite via Internet, restano fermi per gli Intermediari Autorizzati gli obblighi di attestazione degli ordini e delle operazioni eseguite previsti dal citato Regolamento CONSOB n. 20307 del 2018 in materia di Intermediari.

L'utilizzo di Internet per l'acquisto/vendita di Azioni non comporta variazioni degli oneri a carico degli investitori.

Non è prevista la possibilità di chiedere via Internet direttamente alla Società il rimborso delle Azioni acquistate sul mercato secondario (rimborso peraltro subordinato alle condizioni di cui al secondo paragrafo della Sezione 4).

6. Operatore a sostegno della liquidità

Société Générale, con sede legale in 29 Boulevard Haussmann, 75009 Parigi, Francia, è stata nominata con apposita convenzione “Specialista”, relativamente alla quotazione delle Azioni del Comparto nel mercato ETFplus. Conformemente a quanto stabilito dal regolamento di Borsa Italiana S.p.A., l’operatore Specialista si è impegnato a sostenere la liquidità delle Azioni nel mercato ETFplus assumendo l’obbligo di esporre in via continuativa prezzi (con spread massimo) e quantità (minime) di acquisto e di vendita delle Azioni secondo le condizioni e le modalità stabilite da Borsa Italiana.

7. Valore indicativo del Patrimonio Netto (iNAV)

Durante lo svolgimento delle negoziazioni, SOLACTIVE (con sede legale in Platz der Einheit 1, 60327 Francoforte, Germania) calcola in via continuativa il valore indicativo del patrimonio netto (iNAV) del Comparto, aggiornandolo ogni quindici secondi.

I codici (ticker) del Comparto per il reperimento dell’iNAV presso gli *info provider* Bloomberg e Reuters sono:

Comparto	Ticker
Lyxor MSCI World Catholic Principles ESG (DR) UCITS ETF	Bloomberg: CATHEUIV Reuters: CATHEURINAV=SOLA

8. Dividendi

Ai sensi del paragrafo “*Classes of Shares*” della sezione “*Characteristics of the Shares*” del prospetto le Azioni contemplate nel presente Documento, di classe “Acc”, sono a capitalizzazione dei proventi che, pertanto, non verranno distribuiti.

Fatto salvo quanto precede, l’entità di eventuali proventi dell’attività di gestione, la data di stacco e quella di pagamento dovranno essere comunicati alla società di gestione del mercato di negoziazione ai fini della diffusione al mercato; tra la data di comunicazione ed il giorno di negoziazione ex-diritto deve intercorrere almeno un giorno di mercato aperto.

B) INFORMAZIONI ECONOMICHE

9. Oneri direttamente o indirettamente a carico dell’investitore e regime fiscale

a Le commissioni di gestione, parte delle spese correnti riportate nel KIID, sono applicate in proporzione al periodo di detenzione delle Azioni. La Società non addebiterà alcuna commissione in occasione di acquisti o vendite di Azioni nel mercato secondario. Verranno addebitate agli investitori le ordinarie commissioni di negoziazione spettanti agli Intermediari Autorizzati, che possono variare a seconda del soggetto prescelto per l’operazione.

Si richiama l’attenzione degli investitori sulla possibilità che l’eventuale margine tra il prezzo di mercato delle Azioni vendute/acquistate nel mercato secondario in una certa data ed il cosiddetto iNAV (valore indicativo del patrimonio netto) per Azione calcolato nel medesimo istante potrebbe rappresentare un ulteriore costo, non quantificabile a priori.

- b Per quanto riguarda il regime fiscale, a norma dell'articolo 10-ter della Legge 23 marzo 1983, n. 77 e successive modifiche, sui proventi conseguiti in Italia derivanti dagli organismi di investimento collettivo in valori mobiliari conformi alle direttive comunitarie e le cui quote o azioni sono collocate nel territorio dello Stato ai sensi del D. Lgs. 24 febbraio 1998, n. 58, è operata una ritenuta del 26%, con aliquota ridotta del 12,50% solo per la eventuale quota dei suddetti proventi attribuibile alla parte di attività dell'OICR investita in titoli di Stato italiani e di altri Paesi indicati dall'Amministrazione finanziaria (c.d. "white list"). La ritenuta è applicata dai soggetti residenti incaricati del pagamento dei proventi medesimi, del riacquisto o della negoziazione delle quote o azioni, sui proventi distribuiti in costanza di partecipazione all'organismo di investimento, sulla differenza tra il valore di riscatto o di cessione delle Azioni e il valore medio ponderato di sottoscrizione o di acquisto delle Azioni; il costo di acquisto deve essere documentato dal partecipante e, in mancanza della documentazione, il costo è documentato con una dichiarazione sostitutiva. In caso di conversioni, la ritenuta è calcolata come sopra descritto sulla differenza tra valore delle quote o azioni di un comparto (il "Comparto di Origine") preso in considerazione per la conversione di tali quote o azioni del Comparto di Origine in quote o azioni di un altro comparto e il valore medio ponderato di sottoscrizione o di acquisto delle quote o azioni del Comparto di Origine. La ritenuta si applica a titolo d'acconto per i proventi derivanti dalle partecipazioni relative all'impresa e a titolo d'imposta in ogni altro caso.

La ritenuta di cui sopra non si applica nei confronti degli organismi di investimento collettivo del risparmio (OICR) di diritto italiano, delle forme pensionistiche complementari istituite in Italia e dei proventi spettanti alle imprese di assicurazione e relativi a quote o azioni comprese negli attivi posti a copertura delle riserve matematiche dei rami vita.

La ritenuta si applica a titolo d'acconto nei confronti di: a) imprenditori individuali, se le partecipazioni sono relative all'impresa; b) società in nome collettivo, in accomandita semplice ed equiparate di cui all'art. 5 del Testo Unico delle Imposte sui Redditi; c) società ed enti di cui alle lettere a) e b) del comma 1 dell'art. 73 TUIR e stabili organizzazioni nel territorio dello Stato delle società e degli enti di cui alla lettera d) del comma 1 del predetto articolo. Nei confronti di tutti gli altri soggetti, compresi quelli esenti o esclusi dall'imposta sul reddito delle società, la ritenuta è applicata a titolo d'imposta.

Con Risoluzioni n.139/E del 7 maggio 2002 e n. 109/E del 16 maggio 2003, l'Agenzia delle Entrate ha fornito dei chiarimenti sul regime fiscale applicabile alle quote o azioni degli OICR aperti quotati. In particolare, in caso di OICR esteri le cui quote o azioni sono accentrare in forma dematerializzata presso Monte Titoli S.p.A., la ritenuta di cui all'art.10-ter della Legge n.77 deve essere applicata dall'intermediario autorizzato.

Ai sensi del Decreto Legge 3 ottobre 2006, n. 262, convertito nella Legge 24 novembre 2006, n. 286, le donazioni ed il trasferimento *mortis causa*, di qualsiasi attività (comprese azioni, obbligazioni e ogni altro strumento finanziario), è sottoposto alla seguente tassazione:

- (a) i trasferimenti a favore del coniuge e dei discendenti o ascendenti in linea retta sono soggetti ad un'imposta sulle successioni e sulle donazioni del 4%, applicabile al valore dei beni oggetto di successione o donazione che ecceda Euro 1.000.000;
- (b) i trasferimenti a favore di parenti fino al quarto grado o di affini in linea collaterale fino al terzo grado sono soggetti ad un'imposta sulle successioni e sulle donazioni del 6% sul valore complessivo dei beni oggetto della donazione o successione. I trasferimenti a favore di fratelli/sorelle sono soggetti ad un'imposta sulle successioni e sulle donazioni ad un tasso del 6% applicabile al valore della successione o della donazione che ecceda Euro 100.000;
- (c) in via generale, qualsiasi altro trasferimento è soggetto ad un'imposta di successione e donazione ad un tasso dell'8% applicabile all'intero valore della successione o donazione.

Ai fini del calcolo della base imponibile per l'imposta di successione si scomputa *pro quota* il valore dei titoli del debito pubblico di cui all'art. 12, comma primo, lett. h) ed i) del D. Lgs. 31 ottobre 1990, n. 346, come successivamente modificato, inclusi nel fondo, secondo quanto chiarito dalla Circolare 15 febbraio 1999, n. 37/E del Ministero dell'Economia e delle Finanze.

C) INFORMAZIONI AGGIUNTIVE

10. Valorizzazione dell'investimento

I NAV per Azione dei Comparti vengono diffusi quotidianamente sul sito www.etf.it e/o www.LyxorETF.it e sul sito Internet di Borsa Italiana all'indirizzo www.borsaitaliana.it.

Il valore patrimoniale netto è calcolato con la frequenza indicata nel Prospetto nel paragrafo VI "Net Asset Value", sezione A "General", con le definizioni di "Calculation Day" e "Valuation Day" contenute nell'"Appendix D" (intitolata "Glossary of Terms") al Prospetto stesso, nonché nella prima pagina del KIID del Comparto e Classe rilevante, e cioè in ogni giorno lavorativo in Lussemburgo.

11. Informativa agli investitori

I seguenti documenti ed i successivi aggiornamenti sono disponibili nel sito Internet della Società e, limitatamente ai documenti di cui alle lettere a) e b), anche nel sito di Borsa Italiana S.p.A. :

- a) l'ultimo Prospetto in inglese, i KIID in italiano dei Comparti quotati in Italia e lo Statuto della Società;
- b) il presente Documento;
- c) l'ultima relazione annuale o semestrale, se successiva.

Gli stessi documenti potranno essere ricevuti gratuitamente a domicilio da qualsiasi interessato; a tal fine, sarà necessario inviare una richiesta scritta alla Società, che disporrà affinché i documenti richiesti vengano inviati agli interessati nel più breve tempo possibile e comunque non più tardi di dieci giorni dal ricevimento della richiesta. Se richiesto, la Società potrà inviare la documentazione di cui sopra anche in formato elettronico mediante tecniche di comunicazione a distanza che consentano al destinatario dei documenti di acquisirne la disponibilità su supporto duraturo.

La Società pubblica su Il Sole 24 Ore entro il mese di febbraio di ogni anno un avviso riguardante l'avvenuto aggiornamento del Prospetto e dei KIID pubblicati.

Gli indirizzi Internet di cui al presente paragrafo sono:

Società: www.etf.it e/o www.LyxorETF.it
Borsa Italiana: www.borsaitaliana.it

Per la Lyxor Index Fund

Per delega

Avv. Francesco P. Crocenzi