

Lyxor Index Fund
Investmentgesellschaft mit variablem Kapital
Eingetragener Sitz: 28-32, Place de la gare, L-1616 Luxemburg
HR Luxemburg B 117.500
(die „Gesellschaft“)

MITTEILUNG AN DIE ANTEILINHABER VON LYXOR INDEX FUND - LYXOR BOFAML € HIGH YIELD EX-FINANCIAL BOND UCITS ETF (DER „TEILFONDS“)

Änderung des Prospekts und der Wesentlichen Anlegerinformationen des Teilfonds

Im Folgenden nicht anderweitig definierte Begriffe besitzen die in der *Satzung* (die „Satzung“) und im aktuellen *Prospekt* der *Gesellschaft* festgelegte Bedeutung.

Luxemburg, 31. Dezember 2020

Sehr geehrte Anteilhaber,

Die *Verwaltungsgesellschaft* und der *Verwaltungsrat* der *Gesellschaft* (der „**Verwaltungsrat**“) informieren die *Anteilhaber* des *Teilfonds* (die „Anteilhaber“) hiermit über die nachstehenden Änderungen (die „Änderungen“), die sie für den *Teilfonds* beschlossen haben.

I. Änderung des Referenzindex

Die Umstellung des *Referenzindex* vom *vorherigen Referenzindex* auf den *neuen Referenzindex* (die „**Indexumstellung**“) erfolgt wie in nachstehender Tabelle angegeben:

Bezeichnung des Teilfonds	Vorheriger Referenzindex	Neuer Referenzindex
LYXOR INDEX FUND – Lyxor BofAML € High Yield Ex-Financial Bond UCITS ETF	BofA Merrill Lynch BB-CCC Euro Developed Markets Non-Financial High Yield Constrained Index	Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index

Die *Indexumstellung* soll *Anteilhabern* eine Exposure im *neuen Referenzindex* ermöglichen, der den Markt für auf EUR lautende hochverzinsliche Unternehmensanleihen umfassender abdeckt.

Außerdem nimmt der *neue Referenzindex* positive Screenings anhand der ESG-Methodik von MSCI vor, die mit einem „Best-in-Class“-Ansatz bewertet, inwieweit ESG-Risiken von den Emittenten im Vergleich zu ihrer Peer-Group gesteuert werden.

Der *neue Referenzindex* ist ein Rentenmarktindex, der von Bloomberg Barclays Indices berechnet, aktualisiert und veröffentlicht wird.

Die vollständige Beschreibung des *neuen Referenzindex* und seines Konstruktionsverfahrens sowie Informationen über seine Zusammensetzung und die jeweiligen Gewichtungen der Komponenten im *neuen Referenzindex* sind auf der Website des Indexanbieters:

<https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-barclays-indices/> verfügbar und im Prospekt enthalten.

II. Ablauf der Indexumstellung

Die *Indexumstellung* erfolgt innerhalb eines Zeitraums von **26 Werktagen** (die „Indexumstellungsphase“).

An jedem Mittwoch (MI) der *Umstellungsphase* (MI=1, wobei der erste Mittwoch und MI=6 der letzte Mittwoch der *Indexumstellungsphase* sind) wird die Exposure wie folgt angepasst:

- $(6 - MI) * 16,7\%$ des Portfolios sind im *vorherigen Referenzindex* investiert, und
- $MI * 16,7\%$ sind im *neuen Referenzindex* investiert.

Die *Indexumstellungsphase* beginnt am **3. Februar 2021** (zum Beginn des Handelstags) und endet am **11. März 2021** (das „Datum des Inkrafttretens“) wie in nachstehender Tabelle angegeben:

Tag der <i>Indexumstellung</i> T	Datum	Wochentag	Jeweiliger Mittwoch der <i>Umstellungsphase</i> MI	<u>Zeitplan 1</u> <u>High Yield</u>	
				Exposure im <i>vorherigen</i> Referenzindex (zum Beginn des Handelstags)	Exposure im <i>neuen</i> Referenzindex (zum Beginn des Handelstags)
0	3.2.2021	Mittwoch	1	100%	0,0%
1	4.2.2021	Donnerstag	-	83,3%	16,7%
2	5.2.2021	Freitag	-	83,3%	16,7%
3	8.2.2021	Montag	-	83,3%	16,7%
4	9.2.2021	Dienstag	-	83,3%	16,7%
5	10.2.2021	Mittwoch	2	83,3%	16,7%
6	11.2.2021	Donnerstag	-	66,7%	33,3%
7	12.2.2021	Freitag	-	66,7%	33,3%
8	15.2.2021	Montag	-	66,7%	33,3%
9	16.2.2021	Dienstag	-	66,7%	33,3%
10	17.2.2021	Mittwoch	3	66,7%	33,3%
11	18.2.2021	Donnerstag	-	50,0%	50,0%
12	19.2.2021	Freitag	-	50,0%	50,0%
13	22.2.2021	Montag	-	50,0%	50,0%
14	23.2.2021	Dienstag	-	50,0%	50,0%
15	24.2.2021	Mittwoch	4	50,0%	50,0%
16	25.2.2021	Donnerstag	-	33,3%	66,7%
17	26.2.2021	Freitag	-	33,3%	66,7%
18	1.3.2021	Montag	-	33,3%	66,7%
19	2.3.2021	Dienstag	-	33,3%	66,7%
20	3.3.2021	Mittwoch	5	33,3%	66,7%
21	4.3.2021	Donnerstag	-	16,7%	83,3%

22	5.3.2021	Freitag	-	16,7%	83,3%
23	8.3.2021	Montag	-	16,7%	83,3%
24	9.3.2021	Dienstag	-	16,7%	83,3%
25	10.3.2021	Mittwoch	6	16,7%	83,3%
26	11.3.2021	Donnerstag	-	0,0%	100,0%

III. Änderung der Bezeichnung des *Teilfonds*

Die Bezeichnung des *Teilfonds* wird mit Wirkung vom *Datum des Inkrafttretens* der *Indexumstellung* wie folgt geändert:

Vorherige Bezeichnung	Neue Bezeichnung
LYXOR INDEX FUND – Lyxor BofAML € High Yield Ex-Financial Bond UCITS ETF	LYXOR INDEX FUND – Lyxor Euro High Yield UCITS ETF

IV. Änderung des Replikationsverfahrens

Das vom *Teilfonds* verwendete Verfahren zur Indexreplikation wird von einem *indirekten Replikationsverfahren* auf ein *direktes Replikationsverfahren* umgestellt (die „Umstellung des Replikationsverfahrens“).

Die *Umstellung des Replikationsverfahrens* erfolgt zwischen dem 11. März 2021 und dem 11. September 2021 (das „**Datum des Inkrafttretens der Umstellung des Replikationsverfahrens**“). Nach Abschluss der *Umstellung des Replikationsverfahrens* wird eine Mitteilung mit der Bestätigung des *Datums des Inkrafttretens der Umstellung des Replikationsverfahrens* auf www.lyxoretf.com veröffentlicht.

Die Exposure in der Wertentwicklung des *neuen Referenzindex* wird mittels *indirekter Replikation* erreicht, wie im Prospekt beschrieben.

Sobald die *Umstellung des Replikationsverfahrens* erfolgt ist, kann der *Teilfonds* zur Erreichung seines *Anlageziels* direkt in ein Portfolio von Wertpapieren oder sonstigen zulässigen Vermögenswerten investieren, die in der Regel den im *neuen Referenzindex* geführten Wertpapieren entsprechen. Zur Optimierung dieses *direkten Replikationsverfahrens* und zur Reduzierung der Kosten von direkten Anlagen in alle Komponenten seines *neuen Referenzindex* kann der *Teilfonds* die Verwendung von Optimierungstechniken wie beispielsweise der so genannten Sampling-Methode beschließen, die darin besteht, in eine Auswahl repräsentativer Komponenten des *neuen Referenzindex* zu investieren, wie in Abschnitt III „Anlageziel und Anlagepolitik“ im *Prospekt* ausführlicher beschrieben.

Bitte beachten Sie, dass die *Umstellung des Replikationsverfahrens* ausschließlich die Art und Weise der Performance-Nachbildung des *neuen Referenzindex* durch den *Teilfonds* betrifft.

V. Zweite Änderung der Bezeichnung des *Teilfonds*

Wir weisen die *Anteilinhaber* darauf hin, dass sich die Bezeichnung des *Teilfonds* mit Wirkung vom *Datum des Inkrafttretens der Umstellung des Replikationsverfahrens* ändern wird.

Vorherige Bezeichnung	Neue Bezeichnung
LYXOR INDEX FUND – Lyxor Euro High Yield UCITS ETF	Lyxor Index Fund – Lyxor ESG Euro High Yield (DR) UCITS ETF

Die durch die *Änderungen* entstehenden Kosten trägt der *Teilfonds*. *Anteilinhaber* sollten beachten, dass die Kosten im Zusammenhang mit den *Änderungen* den Nettoinventarwert des *Teilfonds* schmälern können.

Alle sonstigen Merkmale des *Teilfonds*, insbesondere aber die für Transaktionen verwendeten Codes und die Gesamtkosten bleiben unverändert.

- *Anteilinhaber*, die *Anteile* am *Teilfonds* in der Regel am Primärmarkt zeichnen oder verkaufen und mit diesen *Änderungen* nicht einverstanden sind, können die kostenlose Rücknahme ihrer *Anteile* innerhalb einer Frist von einem Monat ab dem Datum dieser Mitteilung beantragen;
- *Anteilinhaber* müssen beachten, dass die *Anteile* des *Teilfonds* an einem Markt oder einer Börse verkauft werden und deshalb möglicherweise Maklergebühren für den Verkauf des *Anteils/der Anteile* des *Teilfonds* zu entrichten sind.
- Falls die *Anteilinhaber* mit den *Änderungen* einverstanden sind, besteht keinerlei Handlungsbedarf ihrerseits.

Im Anschluss an die *Änderungen* werden der *Prospekt* und die *Wesentlichen Anlegerinformationen* des *Teilfonds* entsprechend aktualisiert.

Der neue *Prospekt* und die *Wesentlichen Anlegerinformationen* des *Teilfonds* sind auf Anfrage bei der *Verwaltungsgesellschaft* unter folgendem Link client-services-etf@lyxor.com oder ab dem *Datum des Inkrafttretens* der *Änderungen* auf der folgenden Internetseite verfügbar: www.lyxoretf.com.

Bitte wenden Sie sich mit allen Fragen an Lyxor Client Services, entweder telefonisch an die Rufnummer: +33 (0)1 42 13 42 14, oder per E-Mail an: client-services-etf@lyxor.com

Mit freundlichen Grüßen

Im Auftrag des Verwaltungsrats