

Este documento le proporciona información fundamental que debe conocer sobre este producto de inversión. No se trata de material comercial. Es una información exigida por ley para ayudarle a comprender la naturaleza, los riesgos, los costes y los beneficios y pérdidas potenciales de este producto y para ayudarle a compararlo con otros productos.

Ossiam ESG Shiller Barclays CAPE® Europe Sector UCITS ETF - 1D (EUR)

Nombre del promotor del fondo: Ossiam

ISIN: IE00080CTQA4

Contacto: www.ossiam.com

Llame al +33 1 84 79 42 70 para más información

El Banco Central de Irlanda es responsable de la supervisión de Ossiam en relación con este documento de información clave.

Ossiam está autorizada en Francia con el n°GP-10000016 y regulada por la AMF.

Fecha: 31/12/2024

1. ¿Qué es este producto?

Tipo: El Fondo es un Organismo de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios (OICVM) ETF gestionado activamente con arreglo a la legislación irlandesa en forma de subfondo de un Vehículo Irlandés de Gestión Colectiva de Activos (ICAV).

Vencimiento: Este producto no tiene una fecha de vencimiento específica. No obstante, este producto puede disolverse o fusionarse, en cuyo caso se le informaría por cualquier medio adecuado previsto por la normativa.

Objetivo: El objetivo del Fondo es ofrecer las rentabilidades totales netas de una selección de valores de renta variable europeos que forman parte del Índice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR (el « Universo de inversión »), a la vez que integrar sistemáticamente cuestiones medioambientales, sociales y de gobernanza (ASG). El Índice está promovido por Barclays Bank plc. El Índice es publicado y calculado por Bloomberg Index Service Limited.

Política de inversión: El universo de inversión del Fondo está compuesto exclusivamente por valores de renta variable europeos incluidos en el índice Shiller Barclays CAPE Europe Sector Value Net TR, al tiempo que integra sistemáticamente cuestiones medioambientales, sociales y de gobernanza ("ASG"). El modelo cuantitativo de la Sociedad gestora aplica un enfoque temático basado en normas que tiene como objetivo evaluar los valores del Universo de inversión de acuerdo con criterios éticos y emisiones de gases de efecto invernadero. El Fondo utiliza el filtro « Best-In-Class » y excluye al menos el 20% de los valores con peores calificaciones de cada sector del Universo de inversión, de acuerdo con indicadores ASG y relacionados con las emisiones de carbono. Los valores que superan el filtro se someten al filtro « Normativo » con el fin de eliminar los valores de empresas implicadas en vulneraciones graves de las normas internacionales de comportamiento empresarial responsable y actividades empresariales controvertidas. El Fondo promueve características medioambientales o sociales, o una combinación de esas características, pero no tiene como objetivo una inversión ostensible. En determinadas condiciones de mercado, podría resultar imposible llevar a cabo la optimización cumpliendo todas las restricciones. En esos casos, la Sociedad gestora podrá reducir proporcionalmente algunas de ellas. Para obtener una descripción detallada del Universo de inversión, véase el apartado « Estrategia de inversión » del suplemento del Fondo.

Asignación de sumas distribuibles: Distribución.

Dirigido a inversores minoristas: Inversores que entienden los riesgos del Fondo y prevén invertir a largo plazo (mínimo 5 años). El Fondo puede ser relevante para inversores que: (i) busquen una inversión orientada al crecimiento aplicando un enfoque de inversión sostenible, (ii) estén interesados en obtener exposición a los mercados europeos de renta variable, ya sea con fines de inversión básica o de diversificación, (iii) tengan un perfil de riesgo elevado y tengan tolerancia a pérdidas significativas. Las acciones de este Fondo no han sido registradas en virtud de la "US Securities Act of 1933" y no pueden ser ofrecidas o vendidas directa o indirectamente por cuenta o en beneficio de una "U.S. Person" tal y como se define en el "Regulation S" de EE.UU. y/o en la "Foreign Account Tax Compliance Act".

A la vista de las disposiciones del Reglamento n° 833/2014 de la UE y del Reglamento 2022/398 de la UE, la suscripción de participaciones de este Fondo está prohibida a cualquier nacional ruso o bielorruso, cualquier persona física residente en Rusia o Bielorrusia o cualquier persona jurídica, entidad u organismo establecido en Rusia o Bielorrusia, excepto los nacionales de un Estado miembro y las personas físicas titulares de un permiso de residencia temporal o permanente en un Estado miembro.

Depositario: The Bank of New York Mellon SA/NV, sucursal de Dublín.

Más información: El reglamento del Fondo y los informes anuales y semestrales están disponibles en la página web de la sociedad gestora y pueden obtenerse gratuitamente previa solicitud por escrito a info@ossiam.com. El valor liquidativo está disponible en el sitio web de la sociedad gestora. www.ossiam.com.

2. ¿Qué riesgos corro y qué podría obtener a cambio?

Indicador de riesgo



El indicador de riesgo supone que usted mantiene este producto **durante 5 años**. El riesgo real puede ser muy diferente si opta por salir antes del vencimiento, y puede obtener menos rentabilidad. El indicador de riesgo le permite evaluar el nivel de riesgo de este producto en comparación con otros. Indica la probabilidad de que este producto incurra en pérdidas en caso de movimientos del mercado o de que no podamos pagarle.

Hemos clasificado el Fondo en la clase de riesgo 4, que es una clase de riesgo medio. En otras palabras, las pérdidas potenciales vinculadas a los resultados futuros del producto se sitúan en un nivel medio, y si la situación se deteriorara en los mercados, es posible que nuestra capacidad para pagarle se viera afectada. El riesgo de liquidez del mercado podría amplificar la variación de los resultados del producto.

Cuidado con el riesgo cambiario. Si las sumas pagadas a usted están en otra moneda, su beneficio final dependerá del tipo de cambio entre las dos monedas. Este riesgo no se tiene en cuenta en el indicador anterior.

Además de los riesgos incluidos en el indicador de riesgo, otros riesgos pueden influir en la rentabilidad del Fondo. Consulte el folleto del Fondo.

Dado que este Producto no ofrece protección frente a los vaivenes del mercado, podría perder la totalidad o parte de su inversión.

Escenarios de rentabilidad

Las cifras indicadas incluyen todos los costes del producto en sí, pero no necesariamente todos los gastos a pagar a su asesor o distribuidor. Estas cifras no tienen en cuenta su situación fiscal personal, que también puede afectar a los importes que reciba. Lo que reciba de este producto depende de la evolución futura de los mercados. La evolución futura de los mercados es aleatoria y no puede predecirse con exactitud. Los escenarios desfavorables, moderados y favorables presentados son ejemplos que utilizan el mejor y el peor rendimiento, así como el rendimiento medio del producto en los últimos 10 años. Los mercados pueden evolucionar de forma muy diferente en el futuro. El escenario de estrés muestra lo que podría conseguirse en situaciones extremas de mercado.

| | | 1 año | 5 años (período de mantenimiento recomendado) |
|-------------------------------|--|------------|--|
| Escenario de tensión | Lo que puede recibir una vez deducidos los costes | EUR 6 933 | EUR 2 191 |
| | Rendimiento medio cada año | -30.7% | -26.2% |
| Escenario desfavorable | Lo que puede recibir una vez deducidos los costes | EUR 8 794 | EUR 10 265 |
| | Rendimiento medio cada año | -12.1% | 0.5% |
| Escenario moderado | Lo que puede recibir una vez deducidos los costes | EUR 9 986 | EUR 14 456 |
| | Rendimiento medio cada año | -0.1% | 7.6% |
| Escenario favorable | Lo que puede recibir una vez deducidos los costes | EUR 14 524 | EUR 16 720 |
| | Rendimiento medio cada año | 45.2% | 10.8% |

Escenario favorable: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre 30/11/2016 and 30/11/2021.

Escenario moderado: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre 30/06/2017 and 30/06/2022.

Escenario desfavorable: este tipo de escenario se produjo para una inversión entre 31/03/2015 and 31/03/2020.

3. ¿Qué pasa si la sociedad de gestión no puede pagar?

El producto es una copropiedad de instrumentos financieros y depósitos independiente de la sociedad gestora de la cartera. En caso de impago, los activos del producto en poder del depositario no se verán afectados. En caso de impago del depositario, el riesgo de pérdida financiera para el producto se ve mitigado por la segregación legal de los activos del depositario de los del producto.

4. ¿Cuáles son los costes?

La persona que le venda o que le asesore sobre este producto puede cobrarle otros gastos. Si es así, esta persona le proporcionará información sobre estos costes y le mostrará el impacto que todos los costes tendrán en su inversión a lo largo del tiempo.

Costes a lo largo del tiempo

| | Costes totales | Impacto sobre la reducción del rendimiento por año* |
|---|----------------|---|
| Con salida después de 1 año | EUR 156 | 1.56% |
| Con salida al final del período de mantenimiento recomendado | EUR 1163 | 1.56% |

Los cuadros muestran los importes deducidos de su inversión para cubrir los distintos tipos de gastos. Estos importes dependen del importe que invierta, del periodo de tiempo que mantenga el producto y de la rentabilidad del producto. Los importes aquí indicados son ilustrativos y se basan en un importe de inversión a modo de ejemplo y en diferentes periodos de inversión posibles. Hemos supuesto:

- Que el primer año recuperaría el importe invertido (rentabilidad anual del 0%). Que para los restantes periodos de tenencia, el producto evoluciona como se indica en el escenario moderado.

- 10.000 EUR invertidos

*Esto ilustra en qué medida los costes reducen la rentabilidad anual durante el periodo de tenencia. Por ejemplo, muestra que si sale al final del periodo de tenencia recomendado, se espera que su rentabilidad media anual sea del 9.2% antes de deducir los costes y del 7.6% después de deducir los costes.

Composición de los costes

El siguiente cuadro muestra (i) el impacto correspondiente a cada año que pueden tener los diferentes tipos de costes en el rendimiento de la inversión al final del periodo de mantenimiento recomendado; (ii) el significado de las distintas categorías de costes.

| | | | Con salida después de 1 año |
|--------------------------|--|---|-----------------------------|
| Costes únicos | Costes de entrada* | Hasta el 0.00% del importe que pague al ingresar la inversión. | EUR 0 |
| | Costes de salida* | Hasta el 0.00% del importe que reciba al salir de la inversión. | EUR 0 |
| Costes corrientes | Costes de operación de la cartera | 0.81% del valor de su inversión al año. | EUR 81 |
| | Otros costes corrientes | 0.75% del valor de su inversión al año. | EUR 75 |
| Costes accesorios | Comisiones de rendimiento | Este producto no está sujeto a comisión de rentabilidad. | --- |
| | Participaciones en cuenta | Este producto no está sujeto a participaciones en cuenta. | --- |

* Mercado secundario: dado que el Subfondo es un ETF, los Inversores que no sean Participantes Autorizados sólo podrán comprar o vender acciones en el mercado secundario. En consecuencia, los Inversores pagarán comisiones de intermediación y/o transacción en relación con sus operaciones en Bolsa. Estas comisiones de intermediación y/o transacción no son cobradas ni pagadas por el Subfondo o la Sociedad gestora, sino a través del intermediario del inversor. Además, los inversores también pueden tener que pagar diferencias entre precio de compra y precio de venta, es decir, la diferencia entre los precios a los que pueden comprarse y venderse las acciones.

Mercado primario: Los Participantes Autorizados que negocien directamente con el Fondo pagarán los costes de transacción asociados al mercado primario.

5. ¿Cuánto tiempo debo mantener la inversión, y puedo retirar dinero de manera anticipada?

Periodo de inversión recomendado : 5 años.

Este producto no tiene un periodo mínimo de inversión recomendado (RHP, Recommended Holding Period) pero está diseñado para la inversión a largo plazo. Cualquier inversión debe considerarse de acuerdo con sus necesidades específicas de inversión y su apetito por el riesgo. Ossiam no considera la idoneidad o conveniencia de esta inversión para su situación personal. Si tiene alguna duda sobre la adecuación de este producto a sus necesidades, debe buscar asesoramiento profesional. Puede comprar o vender sus títulos ETF diariamente en el mercado secundario a través de un intermediario en las bolsas de valores en las que se negocian los títulos ETF.

Procesamiento de solicitudes:

Las órdenes de suscripción y reembolso se reciben antes de las 13:45 horas (hora de Dublín) del Día de valoración. Las acciones de la Clase 1D (EUR) cotizan en una o varias Bolsa(s) de Valore(s) y los inversores pueden comprar o vender acciones a través de su broker habitual en cualquier día de valoración de la(s) Bolsa(s) de Valore(s) pertinente(s) que sea también un Día de valoración en Irlanda o, a través de una plataforma de distribución de fondos. Para obtener más información, consulte el Folleto y/o póngase en contacto con su broker.

6. ¿Cómo puedo reclamar?

Puede presentar una queja sobre el producto o la conducta de (i) la Sociedad Gestora (ii) una persona que asesora sobre el producto, o (iii) una persona que venda el producto enviando un correo electrónico o una carta a las siguientes personas, según corresponda :

- Si su reclamación se refiere al producto en sí o a la conducta de la Sociedad Gestora : diríjase a la Sociedad Gestora, por correo postal, a la atención de OSSIAM - Compliance o por correo electrónico a info@ossiam.com. En el sitio web de la sociedad gestora www.ossiam.com encontrará un procedimiento de tramitación de reclamaciones.

7. Otros datos de interés

Categoría SFDR: Artículo 8

Seguro de vida: Cuando este producto se utiliza como unidad de inversión en un contrato de seguro de vida o de capitalización, la información adicional sobre este contrato, como los costes del contrato, que no están incluidos en los costes indicados en este documento, el contacto en caso de siniestro y lo que ocurre en caso de incumplimiento por parte de la compañía de seguros, se presentan en el documento de datos fundamentales de este contrato que debe facilitarle su asegurador o corredor o cualquier otro mediador de seguros de acuerdo con su obligación legal.

