

DOCUMENTO DE DATOS

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

OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE US SECTOR VALUE TR - UCITS ETF 1C (EUR)

Nombre del promotor del fondo : Ossiam

ISIN : LU1079841273

Contacto: www.ossiam.com

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

La Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) 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 : 01/11/2025

1. ¿Qué es este producto ?

Tipo : El Fondo es un Organismo de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios (OICVM) ETF de Derecho luxemburgués gestionado pasivamente en forma de subfondo de una Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV).

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 de inversión de OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR (el "Fondo") es replicar, antes de comisiones y gastos del Fondo, la rentabilidad del nivel de cierre del índice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR. El Fondo está gestionado pasivamente. El índice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR (el "Índice") es un índice de rentabilidad total (con reinversión de dividendos netos) promovido por Barclays (el "Proveedor del Índice"), y calculado y publicado por Bloomberg Index Services Limited (el "Agente de Cálculo"). Se expresa en dólares estadounidenses (USD). El índice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR refleja la rentabilidad de una exposición larga dinámica a cuatro sectores estadounidenses que se seleccionan cada mes según su CAPE® relativo (PER ajustado cíclicamente) y variaciones de precio en los 12 meses anteriores ("impulso de precios a 12 meses"). La exposición a sectores de renta variable estadounidenses se obtiene a través de los índices S&P Select Sector (los "Subíndices"), que reflejan la rentabilidad de empresas estadounidenses incluidas en el índice S&P 500. Los componentes sectoriales del Índice se seleccionan cada mes con la metodología de la serie de índices Shiller Barclays CAPE®. Cada uno de los Subíndices seleccionados recibe la misma ponderación en cada reajuste. Para obtener una descripción detallada del Índice, consulte la sección "Descripción del Índice" del Anexo del Fondo en el Folleto.

Política de inversión : Para conseguir su objetivo de inversión, el fondo utilizará principalmente swaps para replicar la rentabilidad del índice mediante réplica sintética. En ese caso, el fondo invertirá en una cartera de activos cuya rentabilidad se intercambiará con la del Índice o un índice relacionado, o una cartera de sus componentes mediante un acuerdo de swap con una contrapartida de swap. Este método conlleva riesgo de contrapartida, como se describe en Perfil de riesgo y remuneración. El valor liquidativo por acción del fondo, por consiguiente, aumentará (o disminuirá) según evolucione el Índice. La contrapartida del swap será una entidad financiera de primera clase y especializada en este tipo de operaciones. El fondo también podrá celebrar múltiples acuerdos de swap con múltiples contrapartidas de swap de las características anteriores. El fondo podrá, teniendo en cuenta el interés de sus Accionistas, decidir cambiar parcial o totalmente una de las políticas descritas arriba por otra (es decir, réplica sintética frente a réplica física). En ambas estrategias de réplica, el fondo permanecerá invertido en todo momento, como mínimo, un 60% en renta variable o derechos emitidos por empresas cuyo domicilio social se encuentre en países de la OCDE.

Asignación de sumas distribuibles : Capitalización.

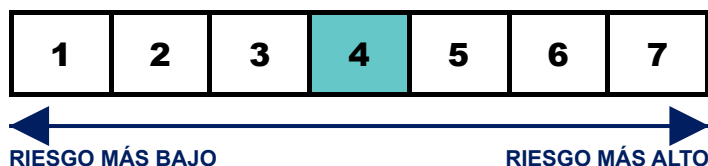
Dirigido a inversores minoristas : Inversores que entienden los riesgos del Fondo y prevén invertir a largo plazo (mínimo 5 años). El Fondo puede ser relevante para inversores que: (i) busquen una inversión orientada al crecimiento, (ii) estén interesados en una exposición a los mercados de renta variable de EE.UU., 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.

Depositorio : State Street Bank International GmbH, Sucursal de Luxemburgo

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 son de nivel medio y, si la situación se deteriorara en los mercados, es posible que nuestra capacidad de pago se viera afectada. El riesgo de liquidez del mercado podría amplificar la variación del rendimiento de los productos.

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 para una inversión de 10 000 EUR, 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 4 101	EUR 3 175
	Rendimiento medio cada año	-58,99%	-20,50%
Escenario Desfavorable	Lo que puede recibir una vez deducidos los costes	EUR 9 030	EUR 17 488
	Rendimiento medio cada año	-9,70%	11,83%
Escenario Moderado	Lo que puede recibir una vez deducidos los costes	EUR 14 009	EUR 19 871
	Rendimiento medio cada año	40,09%	14,72%
Escenario Favorable	Lo que puede recibir una vez deducidos los costes	EUR 15 212	EUR 25 048
	Rendimiento medio cada año	52,12%	20,16%

Escenario Desfavorable:

Este tipo de escenario ocurrió para una inversión entre 30/10/2015 y 30/10/2020

Escenario Moderado:

Este tipo de escenario ocurrió para una inversión entre 30/04/2018 y 28/04/2023

Escenario Favorable:

Este tipo de escenario ocurrió para una inversión entre 31/03/2020 y 31/03/2025

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 104	1,04%
Con salida al final del período de mantenimiento recomendado	EUR 748	0,74%

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 muestra en qué medida los costos reducen su rendimiento anual durante el período de tenencia. Por ejemplo, muestra que si sale al final del período de tenencia recomendado, su rendimiento promedio anual podría ser 15.46% antes de los costes y 14.72% después de 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 período 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 paga al iniciar la inversión.	EUR 0
	Costes de salida*	Hasta el 0.00% del importe que paga al salir de la inversión.	EUR 0
Costes corrientes	Costes de operación de la cartera	0.01% del valor de su inversión por año.	EUR 1
	Otros costes corrientes	0.65% del valor de su inversión por año.	EUR 65
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 diferenciales 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 16:00 horas (hora de Luxemburgo). Las acciones de la Clase UCITS ETF 1C (EUR) cotizan en una o varias Bolsa(s) de Valore(s). Inversores pueden comprar o vender acciones mediante su broker habitual en cualquier día de valoración en la(s) Bolsa(s) de Valore(s) correspondiente(s) que sea también un día de valoración, o a través de una plataforma de distribución de fondos. Para más información, por favor, póngase en contacto con su broker. Para más información, consulte la sección titulada "Suscripción, transferencia, conversión y reembolso de acciones" y la sección titulada "Información práctica" en el Apéndice del Folleto.

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.
- Si su reclamación se refiere a una persona que asesora u ofrece el producto, diríjase directamente a dicha persona.

7. Otros datos de interés

Categoría SFDR : Artículo 6

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.