

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 de promoción comercial. La ley exige que se facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del Fondo y los riesgos que comporta invertir en él. Es aconsejable que lea el documento para poder tomar una decisión fundada sobre la conveniencia o no de invertir en él.



NATIXIS CONSERVATIVE RISK PARITY es un subfondo de NATIXIS AM FUNDS (la «SICAV»).

R/A (EUR) ISIN LU0935227537 - R/D (EUR) ISIN LU0935227701

Natixis Investment Managers International forma parte del Grupo BPCE y es la Sociedad Gestora del Fondo.

OBJETIVOS Y POLÍTICA DE INVERSIÓN

- El objetivo de inversión del Subfondo es superar en más de un 4 % (bruto de comisiones) el tipo de interés ESTR, capitalizado a diario (su índice de referencia). Basado en una balanza de riesgos de una amplia gama de clases de activos, el Subfondo obtiene crecimiento del capital y rendimientos positivos a largo plazo en ciclos de mercado y económicos durante un periodo de inversión mínimo recomendado de tres años. El tipo de interés ESTR (siglas en inglés del tipo a corto plazo del euro) refleja el coste de financiación de las entidades de crédito de la zona del euro en el mercado mayorista de depósitos a un día.
- El Subfondo se gestiona de forma activa. A título meramente indicativo, la rentabilidad del Subfondo podrá compararse con la del Índice de referencia. En la práctica, es probable que la cartera del Subfondo incluya componentes del Índice de referencia, pero el Gestor de inversiones tiene plena discreción para seleccionar los valores que componen la cartera siempre y cuando respete los límites dispuestos en la política de inversión del Subfondo. Sin embargo, no tiene por objeto reproducir dicho Índice de referencia y, por lo tanto, puede desviarse significativamente del mismo.
- De conformidad con la Directiva sobre OICVM, la política de inversión es flexible y dinámica y se apoya en un riguroso análisis de la macroeconomía y los ciclos de mercado. La estrategia pretende sacar provecho de las tendencias de mercado favorables con una sensibilidad reducida a las correcciones de los mercados y a los ciclos de mercado descendentes. La asignación de los mercados mundiales del Subfondo se fundamenta de manera estratégica en los tres pilares siguientes: renta variable, bonos y activos de diversificación.
- El Subfondo puede tener exposición (como % de su patrimonio neto) directa o indirectamente a través de OICVM, OIC, ETF/ETC de duración indefinida y derivados a: renta variable (máx. 30 %, incluida la renta variable de los mercados emergentes), bonos (máx. 100 %, sin incluir fondos del mercado monetario) y activos de diversificación (máx. 40 %), que comprenden instrumentos líquidos con el fin de obtener exposición a materias primas (máx. 10 % no directamente), valores inmobiliarios cotizados (por ejemplo, negociados en un mercado regulado) (máx. 10 % a través de ETF de duración indefinida únicamente), renta variable privada cotizada (máx. 10 % a través de ETF de duración indefinida únicamente), infraestructura cotizada (máx. 10 % de su patrimonio neto, a través de ETF únicamente), deuda emergente (máx. 10 %), deuda de alto rendimiento (por debajo de la calificación BBB- de Standard & Poor's o equivalente de acuerdo con el análisis de la Sociedad Gestora) (máx. 10 %) y OIC de rentabilidad absoluta (máx. 20 %).
La Sociedad Gestora se apoya en la evaluación del riesgo de crédito llevada a cabo por su equipo y en su propia metodología. El Subfondo no se gestiona con un objetivo de volatilidad. Con fines indicativos, se prevé que la volatilidad media anualizada oscile entre el 3 % y el 6 % por encima del periodo de inversión mínimo recomendado de tres años. La volatilidad de un activo viene dada por la magnitud de sus variaciones durante un periodo de tiempo dado. El Subfondo puede invertir hasta el 100 % en un OIC (incluidos los fondos del mercado monetario) y puede tener una exposición al riesgo de divisas de hasta el 100 % de su patrimonio neto. El Subfondo puede invertir hasta un 20 % de su patrimonio neto en instrumentos del mercado monetario y equivalente de efectivo. La duración modificada del Subfondo (una medición de la relación entre la variación en el precio y la variación en los tipos de interés) puede oscilar entre -2 y 8.
- El Subfondo podrá utilizar derivados con fines de cobertura e inversión.
- Los ingresos percibidos por el Subfondo se reinvierten en el caso de las Acciones de acumulación y se distribuyen en el caso de las Acciones de distribución.
- Los Accionistas podrán reembolsar sus Acciones, previa solicitud, en cualquier día hábil tanto de Francia como de Luxemburgo antes de las 13:30 horas.

PERFIL DE RIESGO Y REMUNERACIÓN



- | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|
- Se ha asignado al Subfondo una categoría en la escala de indicación sintética de riesgo y remuneración, debido a su exposición a mercados de renta variable, mercados de renta fija y activos de diversificación, dentro de una estrategia flexible de asignación de activos.
 - Los datos históricos pueden no constituir una indicación fiable de la evolución futura.
 - La categoría de riesgo indicada no puede garantizarse y puede variar a lo largo del tiempo. No puede garantizarse el capital ni existe protección sobre el valor del Subfondo.
 - La asignación a la categoría más baja no significa que la inversión esté libre de riesgo.

Cabe la posibilidad de que el indicador de riesgo y remuneración no capte totalmente los riesgos que se citan a continuación:

- Riesgo de crédito: el riesgo de crédito surge debido al riesgo de deterioro de la calidad de un emisor y/o una emisión, lo que podría implicar una pérdida de valor del título. También puede producirse en casos de impago al vencimiento por parte de un emisor en la cartera.
 - Riesgo de contraparte: el riesgo de contraparte viene dado por el riesgo de que una contraparte con la que el OICVM haya concertado transacciones extrabursátiles (OTC) no sea capaz de cumplir sus obligaciones con el OICVM.
 - Impacto de las técnicas de gestión: El riesgo vinculado a las técnicas de gestión viene dado por el riesgo de pérdidas mayores producto del uso de instrumentos derivados financieros y/o transacciones de préstamo de valores y de recompra.
- La sección «Riesgos principales» del Folleto recoge otros riesgos de inversión.

GASTOS DEL FONDO

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

Gastos de entrada 3,00 %

Gastos de salida Ninguna

Este es el máximo que puede detraerse de su capital antes de proceder a la inversión. Le rogamos consulte con su asesor financiero o el distribuidor para conocer los gastos reales.

Gastos detraídos del Fondo a lo largo de un año:

Gastos corrientes 1,65 %

Gastos detraídos del Fondo en determinadas condiciones específicas:

Comisión de rentabilidad Ninguna

Los gastos que usted soporta están destinados a sufragar los costes de funcionamiento del Fondo, incluidos los costes de comercialización y distribución. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de su inversión.

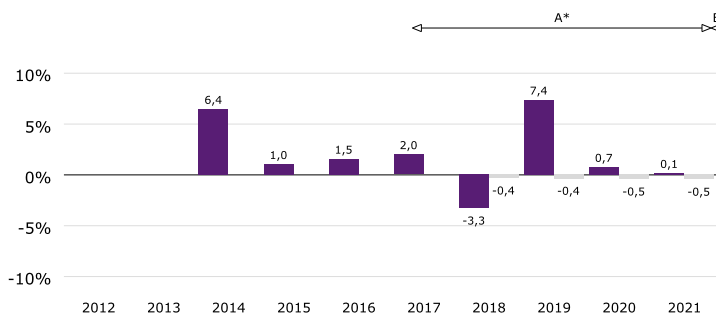
La cifra de gastos corrientes se basa en los gastos del ejercicio cerrado a junio de 2021. Dicha cifra puede variar de un año a otro.

Los gastos corrientes no incluyen lo siguiente:

- Comisiones de rentabilidad.
- Costes de transacción de la cartera, excepto en caso de que el Fondo pague gastos de entrada o de salida cuando compre o venda participaciones de otro organismo de inversión colectiva.

Si desea más información acerca de los gastos, consulte la sección «Comisiones y Gastos» del Folleto, que se encuentra disponible en www.im.natixis.com.

RENTABILIDAD HISTÓRICA



■ R/A (EUR) y R/D (EUR)

■ Índice de referencia

A*: Nuevo índice de referencia: tipo de interés EONIA, capitalizado a diario, desde el 24 de abril de 2017.

B*: Nuevo índice de referencia: tipo de interés ESTR, capitalizado a diario, desde el 15 de diciembre de 2021.

- El Subfondo se creó en 2013.
- Las Clases de acciones R/A (EUR) y R/D (EUR) se crearon en 2013.
- El gráfico de rentabilidad mostrado no constituye una indicación fiable de la rentabilidad futura.
- La rentabilidad anual se calcula una vez deducidos los costes aplicados por el Subfondo.
- Divisa: Euro.
- La rentabilidad del Subfondo no está vinculada a la del índice de referencia. El índice de referencia debe utilizarse como un comparador.

INFORMACIÓN PRÁCTICA

- El Subfondo mantiene sus activos depositados en CACEIS Bank, Luxembourg Branch. Los activos y los pasivos de cada subfondo están segregados. Por tanto, los derechos de inversores y acreedores relativos a un subfondo se limitan a los activos de ese subfondo, a menos que se indique lo contrario en los documentos de constitución de la SICAV.
- Puede obtenerse, sin coste alguno, información adicional acerca del Subfondo, incluido el Folleto vigente, los estados financieros más recientes y los últimos precios de las acciones del Subfondo, así como información de otras clases de acciones y las distintas versiones de este documento en otros idiomas, en www.im.natixis.com o en el domicilio social de la Sociedad Gestora.
- Puede encontrar más información acerca de la política de remuneración en www.im.natixis.com y existen copias impresas disponibles de forma gratuita previa solicitud.
- Fiscalidad: Dependiendo de cuál sea su país de residencia, esto podría incidir sobre su inversión. Si desea obtener más información, contacte con un asesor.
- Natixis Investment Managers International únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes con respecto a las correspondientes partes del Folleto del Subfondo.