DOCUMENTO CONTENENTE LE INFORMAZIONI

Il presente documento contiene informazioni chiave relative a questo prodotto d'investimento. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni, prescritte per legge, hanno lo scopo di aiutarvi a capire le caratteristiche, i rischi, i costi, guadagni e le perdite potenzialidi questo prodotto e di aiutarvi a fare un raffronto con altri prodotti d'investimento.

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

Nome del promotore del fondo: Ossiam

ISIN: IE00080CTQA4

Contatto: www.ossiam.com

Chiamare il +33 1 84 79 42 70 per ulteriori informazioni

La Banca centrale d'Irlanda è responsabile della supervisione di Ossiam in relazione al presente documento contenente le informazioni chiave.

Ossiam è autorizzata in Francia con il n°GP-10000016 e regolamentata dall'AMF.

Data: 31/12/2024

1. Cos'è questo prodotto?

Tipo: Il Fondo è un ETF a gestione attiva di organismi di investimento collettivo in valori mobiliari (OICVM) di diritto irlandese, sotto forma di comparto di un veicolo irlandese di gestione collettiva del risparmio (ICAV).

Scadenza: Questo prodotto non ha una data di scadenza specifica. Tuttavia, questo prodotto può essere sciolto o fuso, nel qual caso sarete informati con i mezzi appropriati previsti dalla normativa.

Obiettivi: L'obiettivo del Fondo è di conseguire i rendimenti totali netti di una selezione di titoli azionari europei che fanno parte dell'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR (l'"Universo di investimento"), integrando al contempo in modo coerente le questioni ambientali, sociali e di governance ("ESG"). L'Indice è sponsorizzato da Barclays Bank plc. L'Indice è pubblicato e calcolato da Bloomberg Index Service Limited.

Politica d'investimento: L'universo d'investimento del Fondo è composto esclusivamente dai titoli azionari dell'Universo d'investimento. La Società di gestione utilizza un proprio modello quantitativo basato su regole tematiche che mira a valutare i titoli dell'Universo di investimento in base a criteri etici e ai contributi alla riduzione delle emissioni di gas serra. Il Fondo utilizza il "filtro Best-in-Class" ed esclude almeno il 20% dei titoli con la peggior classificazione di ciascun settore dell'Universo di investimento in base ai dati ESG e relativi alle emissioni di carbonio. I titoli che superano il filtro vengono esaminati attraverso il "Filtro normativo", che mira a eliminare i titoli di società coinvolte in gravi violazioni di norme diffuse a livello internazionale in materia di comportamento aziendale responsabile e in attività commerciali controverse. Il fondo non promuove caratteristiche ambientali e/o sociali, o una combinazione di queste caratteristiche, e non ha come obiettivo un investimento sostenibile. In determinate condizioni di mercato, potrebbe essere impossibile effettuare un'ottimizzazione nel rispetto di tutti i vincoli. In tali circostanze, la società di gestione può ridurre proporzionalmente alcune di queste percentuali. Per una descrizione dettagliata della strategia di investimento, si rimanda alla sezione "Strategia di investimento" nel supplemento al prospetto del Fondo.

Assegnazione delle somme distribuibili: Distribuzione.

Investitori al dettaglio a cui si intende commercializzare il prodotto: Investitori che comprendono i rischi del Fondo e che prevedono di investire nel lungo termine (minimo 5 anni). Il Fondo può rivolgersi agli investitori che: (i) desiderano un investimento orientato alla crescita con un approccio di investimento sostenibile, (ii) desiderano acquisire un'esposizione ai mercati azionari europei, sia per un investimento di base che a fini di diversificazione, (iii) hanno un profilo di rischio elevato e possono sostenere perdite significative. Le azioni di questo Fondo non sono state registrate ai sensi dello "US Securities Act del 1933" e non possono essere offerte o vendute direttamente o indirettamente per conto o a beneficio di una "U.S. Person" secondo la definizione della "Regulation S" statunitense e/o del "Foreign Account Tax Compliance Act".

In considerazione delle disposizioni del Regolamento UE n. 833/2014 e del Regolamento UE 2022/398, la sottoscrizione di azioni di questo Fondo è vietata a qualsiasi cittadino russo o bielorusso, a qualsiasi persona fisica residente in Russia o Bielorussia o a qualsiasi persona giuridica, entità o organismo stabilito in Russia o Bielorussia, ad eccezione dei cittadini di uno Stato membro e delle persone fisiche in possesso di un permesso di soggiorno temporaneo o permanente in uno Stato membro.

Depositario: The Bank of New York Mellon SA/NV, Filiale di Dublino.

Ulteriori informazioni: Il regolamento del Fondo e le relazioni annuali e semestrali sono disponibili sul sito web della società di gestione e gratuitamente su richiesta scritta all'indirizzo info@ossiam.com. Il valore patrimoniale netto è disponibile sul sito web della società di gestione. www.ossiam.com

2. Quali sono i rischi e qual è il potenziale rendimento?

Indicatore di Rischio



L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto venga conservato **per 5 anni**. Il rischio reale può essere molto diverso se si sceglie di uscire prima della scadenza e si può ottenere un rendimento inferiore. L'indicatore di rischio consente di valutare il livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri. Esso indica la probabilità che questo prodotto subisca delle perdite in caso di movimenti di mercato o di incapacità da parte nostra di pagarvi.

Abbiamo classificato il Fondo nella classe di rischio 4, che è una classe di rischio media. In altre parole, le perdite potenziali legate ai risultati futuri del prodotto sono di livello medio e, se la situazione dovesse peggiorare sui mercati, è possibile che la nostra capacità di pagarvi ne risenta.

Il rischio di liquidità del mercato potrebbe amplificare la variazione delle performance del prodotto.

Attenzione al rischio di cambio. Se le somme versate sono in un'altra valuta, il vostro profitto finale dipenderà dal tasso di cambio tra le due valute. Questo rischio non è preso in considerazione nell'indicatore di cui sopra.

Oltre ai rischi inclusi nell'indicatore di rischio, altri rischi possono influenzare la performance del Fondo. Si prega di fare riferimento al prospetto informativo del Fondo.

Poiché questo Prodotto non fornisce protezione contro gli imprevistidel mercato, potreste perdere tutto o parte del vostro investimento.

Scenari di Performance

Le cifre indicate comprendono tutti i costi del prodotto stesso, ma non necessariamente tutte le spese da pagare al vostro consulente o distributore. Queste cifre non tengono conto della vostra situazione fiscale personale, che può influire sugli importi ricevuti.L'importo ricevuto da questo prodotto dipende dall'andamento futuro dei mercati. L'andamento futuro dei mercati è aleatorio e non può essere previsto con precisione. Gli scenari sfavorevoli, moderati e favorevoli presentati sono esempi che utilizzano le performance migliori e peggiori, nonché la performance media del prodotto negli ultimi 10 anni. I mercati potrebbero evolvere in modo molto diverso in futuro. Lo scenario di stress mostra i risultati che si potrebbero ottenere in situazioni di mercato estreme.

		1 anno	**5 anno** (periodo di detenzione raccomandato)
Scenario di stress	**Possible rimborso al netto dei costi**	EUR 6 933	EUR 2 191
	Rendimento medio per ciascun anno	-30.7%	-26.2%
Scenario sfavorevole	**Possible rimborso al netto dei costi**	EUR 8 794	EUR 10 265
	Rendimento medio per ciascun anno	-12.1%	0.5%
Scenario moderato	**Possible rimborso al netto dei costi**	EUR 9 986	EUR 14 456
	Rendimento medio per ciascun anno	-0.1%	7.6%
Scenario favorevole	**Possible rimborso al netto dei costi**	EUR 14 524	EUR 16 720
	Rendimento medio per ciascun anno	45.2%	10.8%

Scenario favorevole: questo tipo di scenario si è verificato per un investimento tra 30/11/2016 and 30/11/2021.

Scenario moderato: questo tipo di scenario si è verificato per un investimento tra 30/06/2017 and 30/06/2022.

Scenario sfavorevole: questo tipo di scenario si è verificato per un investimento tra 31/03/2015 and 31/03/2020.

3. Cosa accade se il società di gestione non è in grado di corrispondere quanto dovuto?

Il prodotto è una comproprietà di strumenti finanziari e depositi separata dalla società di gestione del portafoglio. In caso di inadempienza di quest'ultima, le attività del prodotto detenute dal depositario non saranno interessate. In caso di inadempienza del depositario, il rischio di perdita finanziaria per il prodotto è mitigato dalla segregazione legale delle attività del depositario da quelle del prodotto.

4. Quali sono i costi?

La persona che vende o fornisce consulenza su questo prodotto potrebbe addebitare altri costi. In tal caso, questa persona fornirà informazioni su questi costi e mostrerà l'impatto che tutti i costi avranno sull'investimento nel tempo.

Andamento dei costi nel tempo

	Costi totali	**Impatto sul rendimento (RIY) per anno***
In caso di disinvestimento dopo 1 anno	EUR 156	1.56%
In caso di disinvestimento alla fine del periodo di detenzione raccomandato	EUR 1163	1.56%

Le tabelle indicano gli importi detratti dall'investimento per coprire i vari tipi di costi. Tali importi dipendono dall'importo investito, dal periodo di detenzione del prodotto e dalla performance del prodotto stesso. Gli importi indicati sono illustrativi e si basano su un importo di investimento esemplificativo e su diversi periodi di investimento possibili.
Abbiamo ipotizzato :
• Che nel primo anno si recuperi l'importo investito (rendimento annuo dello 0%). Che per i restanti periodi di detenzione il prodotto si evolva come indicato nello scenario moderato.
• 10.000 EUR investiti

*Questo dato illustra la misura in cui i costi riducono il rendimento annuo nel corso del periodo di detenzione. Ad esempio, mostra che se si esce alla fine del periodo di detenzione raccomandato, il rendimento medio annuo dovrebbe essere del 9.2% prima della deduzione dei costi e del 7.6% dopo la deduzione dei costi.

Composizione dei costi

La seguente tabella presenta (i) 'impatto, per ciascun anno, dei differenti tipi di costi sul possibile rendimento dell'investimento alla fine del periodo di detenzione raccomandato, (ii) l significato delle differenti categorie di costi.

			In caso di disinvestimento dopo 1 anno
Costi una tantum	**Costi di ingresso***	Fino al 0.00% dell'importo versato al momento dell'investimento.	EUR 0
	Costi di uscita*	Fino al 0.00% dell'importo ricevuto al momento dell'uscita dall'investimento.	EUR 0
Costi correnti	**Costi di transazione**	0.81% del valore del vostro investimento all'anno.	EUR 81
	Altri costi correnti	0.75% del valore del vostro investimento all'anno.	EUR 75
Oneri accessori	**Commissioni di performance**	Non è prevista una commissione di performance per questo prodotto.	---
	Carried interests	Non è prevista una carried interests per questo prodotto.	---

* Mercato secondario: poiché il Comparto è un ETF, gli Investitori che non sono Partecipanti autorizzati potranno generalmente acquistare o vendere azioni solo sul mercato secondario.mercato secondario. Di conseguenza, gli Investitori pagheranno commissioni di intermediazione e/o di transazione in relazione alle loro operazioni in Borsa. Tali commissioni di intermediazione e/o di transazionenon sono addebitate o pagabili dal Comparto o dalla Società di gestione, ma attraverso l'intermediario dell'investitore. Inoltre, gli investitori possono essere tenuti aspread denaro-lettera", ossia la differenza tra i prezzi di acquisto e di vendita delle azioni.
Mercato primario: i Partecipanti autorizzati che negoziano direttamente con il Fondo pagheranno i costi di transazione associati al mercato primario.

5. Per quanto tempo devo detenerlo? Posso ritirare il capitale prematuramente?

Periodo di detenzione raccomandato: 5 anni

Questo prodotto non ha un periodo minimo richiesto di detenzione raccomandato (RHP, Recommended Holding Period), ma è concepito per un investimento a lungo termine. Qualsiasi investimento deve essere considerato in funzione delle specifiche esigenze d'investimento e della propensione al rischio. Ossiam non valuta l'idoneità o l'adeguatezza di questo investimento rispetto alle circostanze personali dell'investitore. In caso di dubbi circa l'idoneità di questo prodotto alle esigenze personali, si raccomanda di chiedere una consulenza professionale adeguata. È possibile acquistare o vendere i titoli ETF giornalmente sul mercato secondario tramite un intermediario, su una o più borse valori in cui i titoli ETF sono negoziati.

Richieste di elaborazione:

Gli ordini di sottoscrizione e di rimborso devono essere ricevuti entro le ore 13.45 (ora di Dublino) del Giorno di negoziazione. Le azioni della Classe 1D (EUR) sono quotate su una o più Borse Valori. Gli investitori possono acquistare o vendere le Azioni, tramite il proprio broker abituale, in qualsiasi giorno di negoziazione della/e Borsa/e di riferimento che sia anche un Giorno di negoziazione in Irlanda o tramite una piattaforma di distribuzione di fondi. Per ulteriori informazioni, si prega di consultare il Prospetto informativo e/o di rivolgersi al proprio intermediario.

6. Como presentare reclami?

È possibile presentare un reclamo sul prodotto o sul comportamento di (i) la Società di gestione (ii) una persona che fornisce consulenza sul prodotto o (iii) una persona che vende il prodotto inviando un'e-mail o una lettera alle seguenti persone, a seconda dei casi :

• Se il reclamo riguarda il prodotto stesso o la condotta della Società di gestione, si prega di contattare la Società di gestione per posta, in 36 rue Brunel 75017 Parigi (Francia) all'attenzione di OSSIAM - Compliance, o per e-mail all'indirizzo info@ossiam.com. Una procedura di gestione dei reclami è disponibile sul sito web della Società di gestione www.ossiam.com.

7. Altre informazioni rilevanti

Categoria SFDR: Articolo 8

Assicurazione sulla vita: Quando questo prodotto è utilizzato come vettore unit-linked in un contratto di assicurazione sulla vita o di capitalizzazione, ulteriori informazioni su questo contratto, come i costi del contratto, che non sono inclusi nei costi indicati in questo documento, il contatto in caso di sinistro e ciò che accade in caso di inadempimento da parte della compagnia di assicurazione, sono presentati nel documento contenente le informazioni chiave di questo contratto che deve essere fornito dal vostro assicuratore o broker o da qualsiasi altro intermediario assicurativo in conformità con i suoi obblighi legali.