

# Documento de Datos Fundamentales

CSIF (IE) DAX 50 ESG Blue UCITS ETF (the "Fund")

Un subfondo de Credit Suisse Index Fund (IE) ETF ICAV (el «ICAV»)

Class B EUR Shares

## ➤ Finalidad

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.

## ➤ Producto

**Nombre:** CSIF (IE) DAX 50 ESG Blue UCITS ETF (the "Fund") Class B EUR Shares

**ISIN:** IE00BKVD2J03

**Productor del PRIIP:** Credit Suisse Asset Management (Switzerland) Ltd.

**Sitio web del Productor del PRIIP:** [www.credit-suisse.com/fundsearch](http://www.credit-suisse.com/fundsearch)

**Teléfono:** +41 44 333 11 11

El Banco Central de Irlanda es responsable de supervisar a Credit Suisse Asset Management (Switzerland) Ltd. en relación con el presente Documento de Datos Fundamentales.

Este PRIIP está autorizado en Irlanda.

Carne Global Fund Managers (Ireland) Limited ha sido autorizado en Irlanda y está regulado por el Banco Central de Irlanda.

Este documento de datos fundamentales es exacto a 1 de enero de 2023.

## ➤ ¿Qué es este producto?

**Tipo:** Este producto es un tipo de organismo de inversión colectiva, específicamente un subfondo de un vehículo irlandés de gestión colectiva de activos OICVM autorizado en Irlanda. Su inversión adoptará la forma de acciones en el Fondo.

**Plazo:** Este Producto no tiene fecha de vencimiento. El Subfondo se ha constituido por un periodo de tiempo indefinido. La Sociedad de gestión podrá liquidar, fusionar o reposicionar el Producto en cualquier momento de manera unilateral en caso de que el Producto ya no pueda gestionarse en beneficio de los inversores. La cantidad que recibirá el inversor en caso de salida anticipada puede ser inferior a la cantidad invertida.

**Objetivos:** El objetivo de inversión del Fondo es proporcionar a los Accionistas un rendimiento acorde con la rentabilidad del DAX 50 ESG Index (el «Índice de referencia»), menos las comisiones y gastos del Fondo.

### Política de inversión

El Fondo aplica una gestión pasiva que pretende replicar la rentabilidad del Índice de referencia. El Índice de referencia replica la rentabilidad de los 50 valores de las empresas más grandes y con mayor liquidez del mercado alemán que tienen una buena rentabilidad comparativa con arreglo a sus criterios ambientales, sociales y de gobernanza (ASG). Estos valores deben haber superado cribados ASG estandarizados relacionados con Sustainalytics Global Standards Screening, así como con relación a armas controvertidas, la producción de tabaco, el carbón-vapor, la energía nuclear y la contratación militar. Sustainalytics Global Standards Screening detecta empresas que incumplen o corren el riesgo de infringir las normas y estándares aceptados de forma general en el ámbito internacional. En condiciones normales del mercado, se espera que el nivel de error de seguimiento previsto sea inferior al 0,70 %.

Con el fin de lograr su objetivo, el Fondo trata de invertir la totalidad o una parte sustancial de sus ingresos netos de las acciones emitidas en una selección representativa de valores de renta variable y asimilados de empresas de tamaño medio y grande, que coticen en el mercado de renta variable alemán y tengan su sede legal o de operaciones en Alemania, relacionados con los integrantes del Índice de referencia. La selección de las inversiones no está condicionada ni por el crecimiento ni por el valor, sino por el objetivo de inversión del Fondo, que consiste en seguir la rentabilidad del Índice de referencia. El fondo también podrá invertir temporalmente en renta variable e instrumentos relacionados con esta y derechos de empresas que no están incluidas en el Índice de referencia. La inversión máxima es del 5 % del valor de inventario neto.

El Fondo también podrá invertir en instrumentos financieros derivados con fines de gestión eficiente de la cartera o para obtener protección frente a los riesgos cambiarios de mercado y de divisas. Estos instrumentos financieros derivados incluyen warrants, contratos a plazo sobre divisas, futuros sobre el Índice de referencia y futuros sobre índices financieros. La exposición global y el apalancamiento de los instrumentos financieros derivados no superará el 100 % del valor liquidativo. Además de los valores arriba mencionados, el Fondo puede invertir en participaciones de organismos de inversión colectiva de gestión pasiva, tanto nacionales como extranjeros, cotizados y no cotizados, que sean coherentes con el objetivo de inversión y cumplan los requisitos del Reglamentos sobre OICVM. El Fondo no invertirá más del 10 % de su valor de inventario neto en otros OICVM u otros organismos de inversión colectiva. Aquellas inversiones que salgan del Índice de referencia deben venderse en un periodo de tiempo adecuado mientras se protegen los intereses de los inversores.

Como organismo de inversión colectiva, el rendimiento del Fondo dependerá totalmente de la rentabilidad de las inversiones de su cartera. Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (el «Depositario») mantiene los activos del Fondo. El Fondo podrá ser rescindido por los Administradores del ICAV en determinadas circunstancias, según se establece en el Folleto. Pueden obtenerse copias gratuitas en inglés del Folleto, el Suplemento del Fondo y los últimos informes anual y semestral en [www.credit-suisse.com/fundsearch](http://www.credit-suisse.com/fundsearch). El precio de las acciones se puede encontrar en [www.credit-suisse.com/fundsearch](http://www.credit-suisse.com/fundsearch).

El Fondo promueve características ASG (con arreglo a lo dispuesto en el artículo 8 del Reglamento (UE) 2019/2088).

La moneda de base del Fondo es el euro.

Los ingresos se reinvertirán automáticamente en el Fondo y se reflejarán en el VL por acción. Usted puede comprar y reembolsar participaciones a diario en cualquier Día hábil (conforme a la definición del Suplemento) que no sea el 2 de enero, el lunes de Pascua, el 1 de mayo, el día de la Ascensión, el lunes de Pentecostés, el 24 de diciembre, el 26 de diciembre y el 31 de diciembre o cualquier otra fecha que los Administradores puedan determinar y así lo notifiquen previamente a los accionistas.

Para obtener más información sobre la política de inversión y la estrategia del Fondo, remítase a la sección «Investment Objective, Investment Policies and Investment Process» (Objetivo de inversión, políticas de inversión y proceso de inversión) del suplemento del Fondo (el «Suplemento»).

**Inversor minorista al que va dirigido:** El Fondo es adecuado para los inversores con una alta tolerancia al riesgo y una perspectiva a largo plazo que desean invertir en una cartera muy diversificada de valores de renta variable.

**Depositario:** Los activos del Fondo se mantienen a través del Depositario, que es Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited.

**Tipo de distribución:** El producto es de acumulación.

## ➤ ¿Qué riesgos corro y qué podría obtener a cambio?

### Indicador de riesgo

Menor riesgo

Mayor riesgo



El indicador de riesgo presupone que usted mantendrá el producto durante 7 años.

El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo 5 en una escala de 7, en la que 5 significa un riesgo medio-alto.

Según esta clasificación, el riesgo de posibles pérdidas de rentabilidad futura es medio-alto y es probable que las condiciones de mercado desfavorables afecten a nuestra capacidad para pagarle.

### Escenarios de rentabilidad

Lo que obtenga de este producto dependerá de la evolución futura del mercado, la cual es incierta y no puede predecirse con exactitud.

Los escenarios desfavorable, moderado y favorable que se muestran son ilustraciones basadas en la rentabilidad más baja, media y más alta del producto/valor de referencia durante los últimos 12 años. Los mercados podrían evolucionar de manera muy distinta en el futuro.

El escenario de tensión muestra lo que usted podría recibir en circunstancias extremas de los mercados.

Las cifras presentadas incluyen todos los costes del producto propiamente dicho, pero es posible que no incluyan todos los costes que usted deba pagar a su asesor o distribuidor. Las cifras no tienen en cuenta su situación fiscal personal, que también puede influir en la cantidad que reciba.

Ejemplo de inversión: 10 000 EUR		1 año	7 años
<b>Mínimo</b>	No hay una rentabilidad mínima garantizada. Usted podría perder la totalidad o parte de su inversión.		
<b>Escenario de tensión</b>	<b>Lo que podría recibir tras deducir los costes</b>	EUR 2,980	EUR 1,890
	<b>Rendimiento medio cada año</b>	-70,19 %	-21,18 %
<b>Escenario desfavorable <sup>1</sup></b>	<b>Lo que podría recibir tras deducir los costes</b>	EUR 8,585	EUR 3,437
	<b>Rendimiento medio cada año</b>	-14.15%	-14.15%
<b>Escenario moderado <sup>2</sup></b>	<b>Lo que podría recibir tras deducir los costes</b>	EUR 10,542	EUR 14,478
	<b>Rendimiento medio cada año</b>	5.43%	5.43%
<b>Escenario favorable <sup>3</sup></b>	<b>Lo que podría recibir tras deducir los costes</b>	EUR 11,142	EUR 21,329
	<b>Rendimiento medio cada año</b>	11.43%	11.43%

<sup>1</sup> Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre el 17/11/2021 y el 07/12/2022

<sup>2</sup> Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre el 16/04/2014 y el 16/04/2021

<sup>3</sup> Este tipo de escenario se produjo para una inversión entre el 21/09/2011 y el 21/09/2018

## ➤ ¿Qué pasa si Credit Suisse Asset Management (Switzerland) Ltd. no puede pagar?

El Depositario mantiene los activos del Fondo bajo custodia. En caso de insolvencia del Productor del PRIIP, los activos del Fondo bajo la custodia del Depositario no se verán afectados. Sin embargo, en caso de insolvencia del Depositario, o de alguien que actúe en su nombre, el Fondo podría sufrir una pérdida financiera y no existe ningún sistema de compensación o garantía que pueda compensar, en su totalidad o en parte, esa pérdida. Este riesgo se ve mitigado por el hecho de que el Depositario está obligado por ley y por normativa a segregar sus propios activos de los del Fondo.

## ➤ ¿Cuáles son los costes?

### Costes a lo largo del tiempo

La persona que le asesore sobre este producto o se lo venda puede cobrarle otros costes. En tal caso, esa persona le facilitará información acerca de estos costes y de la incidencia que tienen en su inversión.

Los cuadros muestran los importes que se deducen de su inversión para cubrir diferentes tipos de costes. Estas cantidades dependen de cuánto invierte y de cuánto tiempo mantiene el producto. Los importes indicados aquí ilustran un ejemplo de inversión de una determinada cuantía durante diferentes periodos de inversión posibles.

Hemos partido de los siguientes supuestos:

- El primer año recuperaría usted el importe invertido (rendimiento anual del 0 %)
- En relación con los demás periodos de mantenimiento, hemos supuesto que el producto evoluciona tal como muestra el escenario moderado
- Se invierten 10 000 EUR

Ejemplo de inversión: 10 000 EUR	Si lo vende después de 1 año	Si lo vende después de 7 años
Costes totales	EUR 12	EUR 102
Incidencia anual de los costes (*)	0.12%	0.12%

(\*) Refleja la medida en que los costes reducen su rendimiento cada año a lo largo del periodo de mantenimiento. Por ejemplo, muestra que, en caso de salida al término del periodo de mantenimiento recomendado, el rendimiento *medio* que se prevé que obtendrá cada año será del 5,55 % antes de deducir los costes y del 5,43 % después de deducir los costes.

### Composición de los costes

La siguiente tabla muestra el impacto correspondiente a cada año que pueden tener los diferentes tipos de costes en el rendimiento de la inversión que podría obtener al final del periodo de mantenimiento recomendado y el significado de las diferentes categorías de costes.

La tabla muestra el impacto en la rentabilidad anual		En caso de salida después de 1 año	
Costes únicos de entrada o salida	Costes de entrada	No cobramos comisión de entrada.	EUR 0
	Costes de salida	No cobramos una comisión de salida por este producto, pero es posible que la persona que se lo venda sí lo haga.	EUR 0
Costes corrientes detraídos cada año	Comisiones de gestión y otros costes administrativos o de funcionamiento	0,12 % del valor de su inversión al año. Se trata de una estimación basada en los costes reales del último año.	EUR 12
	Costes de operación	0,00 % del valor de su inversión al año. Se trata de una estimación de los costes en que incurrimos al comprar y vender las inversiones subyacentes del producto. El importe real variará en función de la cantidad que compremos y vendamos.	EUR 0.44
Costes accesorios detraídos en condiciones específicas	Comisiones de rendimiento y participaciones en cuenta	No se aplica ninguna comisión de rendimiento a este producto.	EUR 0

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

El periodo de mantenimiento mínimo recomendado: 7 años.

En función del perfil de riesgo/rentabilidad, recomendamos un periodo de mantenimiento de al menos 7 años. Si reembolsa antes del final del periodo de mantenimiento recomendado, puede haber un mayor riesgo de recibir una rentabilidad más baja de su inversión o de sufrir pérdidas.

Normalmente, podrá solicitar la compra o venta de acciones del subfondo cualquier día hábil (según se establezca en el folleto del Fondo).

## ➤ ¿Cómo puedo reclamar?

Si tiene alguna reclamación sobre el producto, la conducta del productor o la persona que le asesora sobre el producto, puede presentarla por los siguientes medios:

Correo electrónico: [fundcomplaints.luxembourg@credit-suisse.com](mailto:fundcomplaints.luxembourg@credit-suisse.com)

Sitio web: [www.credit-suisse.com/fundsearch](http://www.credit-suisse.com/fundsearch)

## ➤ Otros datos de interés

Más información: Estamos obligados a proporcionarle documentación adicional, como el último folleto del producto y los informes anuales y semestrales. Estos documentos y otra información del producto están disponibles en [www.credit-suisse.com/fundsearch](http://www.credit-suisse.com/fundsearch).

Tenga en cuenta que la rentabilidad histórica no es indicativa de la rentabilidad futura. No es una garantía de la rentabilidad que puede recibir en el futuro. Este es el primer documento en el que el Fondo ofrece un análisis de escenarios. La rentabilidad histórica y los cálculos mensuales de escenarios de rentabilidad anteriores pueden encontrarse en [www.credit-suisse.com/fundsearch](http://www.credit-suisse.com/fundsearch).