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 (USD)

Nombre del promotor del fondo : Ossiam
ISIN : LU1079841513

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 : 31/12/2025

1. ¿Qué es este producto ?

Tipo : El Fondo es un organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) gestionado de forma pasiva, constituido como un fondo cotizado en bolsa (ETF) conforme a la legislación luxemburguesa, constituido como un 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 del Fondo es replicar, antes de las comisiones y gastos del Fondo, el rendimiento del nivel de cierre del índice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR. El índice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR (el «Índice») es un índice de rentabilidad total (dividendos netos reinvertidos) expresado en USD, patrocinado por Barclays (el «Proveedor del Índice») y calculado y publicado por Bloomberg Index Services Limited (el «Agente de Cálculo»). Para obtener una descripción detallada del Índice, consulte la sección «Descripción del Índice» del Folleto. El nivel previsto de error de seguimiento en condiciones normales es del 0,50 % durante un periodo de un año.

Política de inversión : Para alcanzar su objetivo de inversión, el Fondo utilizará principalmente swaps con el fin de replicar sintéticamente el rendimiento del Índice. En ese caso, el Fondo invertirá en una cartera de activos cuyo rendimiento se intercambiará por el rendimiento del Índice o de un índice relacionado, o por una cartera de sus componentes, mediante acuerdos de swap con una contraparte de swap. Este método implica un riesgo de contraparte, tal y como se describe en la sección «Perfil de riesgo y rentabilidad» del Folleto. Por lo tanto, el valor liquidativo por Acción del Fondo aumentará (o disminuirá) en función de la evolución del Índice. La contraparte de los swaps será una entidad financiera de primer orden especializada en este tipo de operaciones. El Fondo también podrá celebrar múltiples acuerdos de permuta con múltiples contrapartes de permuta con las mismas características que las descritas anteriormente. En caso de réplica sintética, puede existir un contrato de licencia de índice entre la(s) contraparte(s) de permuta y el proveedor del índice; por lo tanto, los costes de la permuta pueden incluir derechos de licencia. El Fondo podrá, teniendo debidamente en cuenta el interés superior de sus Accionistas, decidir cambiar parcial o totalmente de la réplica sintética (como se describe anteriormente) a la réplica física. En ambas estrategias de réplica, el Fondo invertirá de forma permanente un mínimo del 60 % en acciones o derechos emitidos por sociedades con domicilio social en países de la OCDE. Además, y de forma complementaria, el Fondo podrá utilizar otros derivados con fines de cobertura e inversión, tal y como se describe en el apartado «Uso de derivados, técnicas especiales de inversión y cobertura» del Folleto. La moneda de referencia del Fondo es el dólar estadounidense.

Asignación de sumas distribuibles : Capitalización.

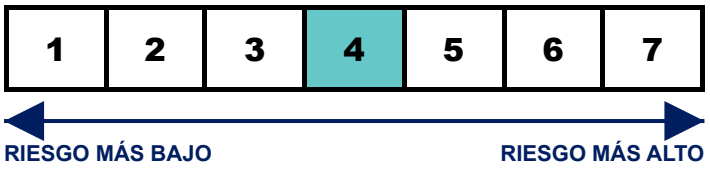
Dirigido a inversores minoristas : El Fondo está destinado a inversores minoristas con capacidad para soportar pérdidas hasta el importe invertido en el Fondo.

Depositario : State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch.

Más información : El reglamento del Fondo y los informes anuales y semestrales están disponibles en el sitio 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**	USD 4 214	USD 2 807
	Rendimiento medio cada año	-57,86%	-22,44%
Escenario Desfavorable	**Lo que puede recibir una vez deducidos los costes**	USD 8 462	USD 16 212
	Rendimiento medio cada año	-15,38%	10,15%
Escenario Moderado	**Lo que puede recibir una vez deducidos los costes**	USD 11 498	USD 19 920
	Rendimiento medio cada año	14,98%	14,78%
Escenario Favorable	**Lo que puede recibir una vez deducidos los costes**	USD 16 307	USD 24 617
	Rendimiento medio cada año	63,07%	19,74%

Escenario Desfavorable:
Este tipo de escenario ocurrió para una inversión entre 29/12/2017 y 30/12/2022

Escenario Moderado:
Este tipo de escenario ocurrió para una inversión entre 30/10/2020 y 31/10/2025

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 pager ?

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 lemostrará 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	USD 65	0,65%
Con salida al final del período de mantenimiento recomendado	USD 571	0,57%

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 USD 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 15.35% antes de los costes y 14.78% 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.	USD 0
	Costes de salida*	Hasta el 0.00% del importe que paga al salir de la inversión.	USD 0
Costes corrientes	**Costes de operación de la cartera**	0.00% del valor de su inversión por año.	USD 0
	Otros costes corrientes	0.65% del valor de su inversión por año.	USD 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). Para obtener más información, consulte el folleto informativo o póngase en contacto con su bróker.

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.