DOCUMENT D'INFORMATIONS CLÉS

Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d'investissement. Il ne s'agit pas d'un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit, quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d'autres produits.

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

Nom de l'initiateur du fonds : Ossiam
ISIN : LU1446552652

Contact: www.ossiam.com

Appelez le +33 1 84 79 42 70 pour de plus amples informations

La Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) est chargée du contrôle d'Ossiam en ce qui concerne ce document d'informations clés.

Ossiam est agréée en France sous le n°GP-10000016 et réglementé par l'AMF.

Date de production : 31/12/2025

1. En quoi consiste ce produit ?

Type : Le Fonds est un Organisme de Placement Collectif en Valeurs Mobilières (OPCVM) géré de manière passive, sous la forme d'un fonds négocié en bourse (ETF, "Exchange Traded Fund") de droit luxembourgeois, constitué sous la forme d'un compartiment d'une Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV).

Échéance : Ce produit n'a pas de date d'échéance spécifique prévue. Cependant, ce produit peut être dissout ou fusionné, dans ce cas, vous en serez informé par tout moyen approprié prévu par la réglementation.

Objectifs : L'objectif du Fonds est de reproduire, avant déduction des frais et dépenses du Fonds, la performance de l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR à la clôture. L'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR (l'« Indice ») est un indice de rendement total (dividendes nets réinvestis) exprimé en USD, sponsorisé par Barclays (le « Fournisseur de l'indice ») et calculé et publié par Bloomberg Index Services Limited (l'« Agent de calcul »). Pour une description détaillée de l'Indice, veuillez vous reporter à la section « Description de l'Indice » du Prospectus. Le niveau prévu d'écart de suivi dans des conditions normales est de 0,50 % sur une période d'un an.

Politique d'investissement : Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds utilisera principalement des swaps dans le but de reproduire la performance de l'Indice par réplication synthétique. Dans ce cas, le Fonds investira dans un portefeuille d'actifs dont la performance sera échangée contre la performance de l'Indice ou d'un indice connexe, ou d'un portefeuille de ses composants, par le biais de contrats de swap conclus avec une contrepartie de swap. Cette méthode implique un risque de contrepartie tel que décrit dans la section « Profil de risque et de rendement » du Prospectus. La valeur nette d'inventaire par Action du Fonds augmentera (ou diminuera) donc en fonction de l'évolution de l'Indice. La contrepartie des swaps sera une institution financière de premier ordre spécialisée dans ce type de transaction. Le Fonds peut également conclure plusieurs contrats de swap avec plusieurs contreparties de swap présentant les mêmes caractéristiques que celles décrites précédemment. En cas de réplication synthétique, un contrat de licence d'indice peut exister entre la ou les contreparties de swap et le fournisseur d'indice ; par conséquent, des frais de licence peuvent être inclus dans les coûts du swap. Le Fonds peut, dans l'intérêt de ses actionnaires, décider de passer partiellement ou totalement de la réplication synthétique (telle que décrite ci-dessus) à la réplication physique. Dans les deux stratégies de réplication, le Fonds sera investi en permanence à hauteur d'au moins 60 % dans des actions ou des droits émis par des sociétés ayant leur siège social dans des pays de l'OCDE. En outre, à titre accessoire, le Fonds peut utiliser d'autres dérivés à des fins de couverture et d'investissement, comme décrit dans la section « Utilisation de dérivés, techniques d'investissement et de couverture spéciales » du Prospectus. La devise de référence du Fonds est le dollar américain. Afin de couvrir le risque de change lié à l'euro (EUR) sur la classe d'actions HEDGED EUR, le Fonds/Compartiment applique une stratégie de couverture qui réduit l'impact des variations entre la devise de l'Indice et la devise de la classe d'actions.

Affectation des sommes distribuables : Capitalisation.

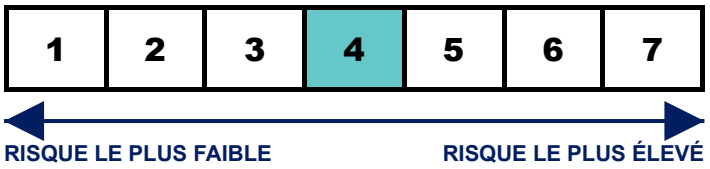
Investisseurs de détail visés : Le Fonds est destiné aux investisseurs particuliers capables de supporter des pertes à hauteur du montant investi dans le Fonds.

Dépositaire : State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch.

Informations complémentaires : Le prospectus et les rapports annuels et semestriels du Fonds sont disponibles sur le site internet de la société de gestion et gratuitement sur simple demande écrite à l'adresse info@ossiam.com. La valeur liquidative est disponible sur le site internet de la société de gestion. www.ossiam.com

2. Quels sont les risques et qu'est-ce que cela pourrait me rapporter ?

Indicateur de risque



L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez ce produit pendant 5 ans. Le risque réel peut être très différent si vous optez pour une sortie avant échéance et vous pourriez obtenir moins en retour. L'indicateur de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

Nous avons classé le Fonds dans la classe de risque 4 qui est une classe de risque moyenne. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau moyen et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est possible que notre capacité à vous payer en soit affectée. Le risque de liquidité du marché peut accentuer la variation des performances du produit.

Attention au risque de change. Si les sommes qui vous sont versées sont libellées dans une autre devise, votre gain final dépendra du taux de change entre les deux devises. Ce risque n'est pas pris en compte dans l'indicateur ci-dessus. Outre les risques inclus dans l'indicateur de risque, d'autres risques peuvent influencer la performance du Fonds. Veuillez vous référer au prospectus du Fonds. Ce produit n'offrant aucune protection contre les aléas du marché, vous pouvez perdre tout ou partie de votre investissement.

Scénarios de performance

Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du produit lui-même, mais pas nécessairement tous les frais dus à votre conseiller ou distributeur. Ces chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, qui peut également avoir une incidence sur les montants que vous recevrez.
Ce que vous recevrez de ce produit dépend des performances futures des marchés. L'évolution future des marchés est aléatoire et ne peut être prédite avec précision. Les scénarios défavorable, modéré et favorable présentés sont des exemples utilisant les meilleures et les pires performances, ainsi que la performance moyenne du produit sur les 10 dernières années. Les marchés peuvent évoluer très différemment à l'avenir. Le scénario de stress montre ce que vous pourriez obtenir dans des situations de marché extrêmes.

		1 an	5 ans (période de détention recommandée)
Scénario de Tension	**Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts**	EUR 4 275	EUR 2 767
	Rendement annuel moyen	-57,25%	-22,66%
Scenario Défavorable	**Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts**	EUR 8 198	EUR 14 180
	Rendement annuel moyen	-18,02%	7,24%
Scenario Intermédiaire	**Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts**	EUR 11 177	EUR 17 537
	Rendement annuel moyen	11,77%	11,89%
Scenario Favorable	**Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts**	EUR 16 007	EUR 21 939
	Rendement annuel moyen	60,07%	17,02%

Scenario Défavorable :
Ce type de scénario s'est produit pour un investissement entre 29/12/2017 et 30/12/2022

Scenario Intermédiaire :
Ce type de scénario s'est produit pour un investissement entre 29/03/2019 et 28/03/2024

Scenario Favorable :
Ce type de scénario s'est produit pour un investissement entre 31/03/2020 et 31/03/2025

3. Que se passe-t-il si l'émetteur n'est pas en mesure d'effectuer les versements ?

Le produit est une copropriété d'instruments financiers et de dépôts distincte de la société de gestion de portefeuille. En cas de défaillance de cette dernière, les actifs du produit conservés par le dépositaire ne seront pas affectés. En cas de défaillance du dépositaire, le risque de perte financière du produit est atténué en raison de la ségrégation légale des actifs du dépositaire de ceux du produit.

4. Que va me coûter cet investissement ?

Il se peut que la personne qui vous vend ce Fonds ou qui vous fournit des conseils à son sujet vous demande de payer des coûts supplémentaires. Si c'est le cas, cette personne vous informera au sujet de ces coûts et vous montrera l'incidence de ces coûts sur votre investissement.

Coût au fil du temps

	Coûts totaux	Réduction du rendement par an*
Si vous sortez après 1 an	EUR 65	0,65%
Si vous sortez après la période de détention recommandée	EUR 516	0,58%

Les tableaux présentent les montants prélevés sur votre investissement afin de couvrir les différents types de coûts. Ces montants dépendent du montant que vous investissez, du temps pendant lequel vous détenez le produit et du rendement du produit. Les montants indiqués ici sont des illustrations basées sur un exemple de montant d'investissement et différentes périodes d'investissement possibles. Nous avons supposé :
• Qu'au cours de la première année vous récupéreriez le montant que vous avez investi (rendement annuel de 0 %). Que pour les autres périodes de détention, le produit évolue de la manière indiquée dans le scénario intermédiaire.
• 10 000 EUR sont investis

*Ceci illustre dans quelle mesure les coûts réduisent annuellement votre rendement au cours de la période de détention. Par exemple, elle montre que si vous sortez à la fin de la période de détention recommandée, il est prévu que votre rendement moyen par an soit de 12.47% avant déduction des coûts et de 11.89% après cette déduction.

Composition des coûts

Le tableau ci-dessous indique l'incidence annuelle des différents types de coûts sur le rendement que vous pourriez obtenir de votre investissement à la fin de la période d'investissement recommandée et la signification des différentes catégories de coûts.

			Si vous sortez après 1 an
Coûts ponctuels	**Coûts d'entrée***	Jusqu'à 0.00% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement.	EUR 0
	Coûts de sortie*	Jusqu'à 0.00% du montant que vous payez au moment de la sortie dans l'investissement.	EUR 0
Coûts récurrents	**Coûts de transaction**	0.00% de la valeur de votre investissement par an.	EUR 0
	Autres coûts récurrents	0.65% de la valeur de votre investissement par an.	EUR 65
Coûts accessoires	**Commissions liées aux résultats**	Il n'y a pas de commission de superformance pour ce produit.	---
	Commissions d'intéressement	Il n'y a pas de commission d'intéressement pour ce produit.	---

* Marché secondaire : dans la mesure où le Compartiment est un ETF, les Investisseurs qui ne sont pas des Participants autorisés ne pourront généralement acheter ou vendre des actions que sur le marché secondaire. Par conséquent, les investisseurs paieront des frais de courtage et/ou de transaction concernant leurs transactions en bourse. Ces frais de courtage et/ou de transaction ne sont ni facturés ni payables par le Compartiment ou la Société de gestion, mais par l'intermédiaire de l'investisseur même. En outre, les investisseurs peuvent également devoir supporter des écarts acheteur-vendeur (« bid-ask spreads »), c'est-à-dire la différence entre les cours auxquels les actions peuvent être achetées et vendues.
Marché primaire : les Participants autorisés qui négocient directement avec le Fonds paieront les coûts de transaction liés au marché primaire.

5. Combien de temps dois-je le conserver, et puis-je retirer de l'argent de façon anticipée ?

Durée de détention recommandée : 5 ans.

Ce produit n'a pas de période de détention minimale recommandée (RHP) mais est conçu pour un investissement à long terme. Tout investissement doit être considéré en fonction de vos besoins spécifiques d'investissement et de votre appétit pour le risque. Ossiam ne considère pas l'adéquation ou le caractère approprié de cet investissement à votre situation personnelle. Si vous avez le moindre doute quant à l'adéquation de ce produit à vos besoins, nous vous conseillons de consulter un professionnel. Vous pouvez acheter ou vendre vos titres d'ETF quotidiennement sur le marché secondaire par le biais d'un intermédiaire sur la ou les bourses de valeurs sur lesquelles les titres d'ETF sont négociés.

Traitement des ordres :

Les ordres de souscription et de rachat sont reçus au plus tard à 15 h 00 (heure du Luxembourg). Pour plus d'informations, veuillez consulter le prospectus et/ou contacter votre courtier.

6. Comment puis-je formuler une réclamation ?

Vous pouvez formuler une réclamation concernant le produit ou le comportement (i) de la société de gestion (ii) d'une personne qui fournit des conseils au sujet de ce produit, ou (iii) d'une personne qui vend ce produit en adressant un courrier électronique ou un courrier postal aux personnes suivantes, selon le cas :
• Si votre réclamation concerne le produit lui-même ou le comportement de la Société de gestion : veuillez contacter la société de gestion, par courrier, au 36 rue Brunel 75017 Paris (France) à l'attention de OSSIAM – Conformité ou par mail à info@ossiam.com. Une procédure de traitement des réclamations est disponible sur le site internet de la société de gestion www.ossiam.com
• Si votre réclamation concerne une personne qui fournit des conseils sur le produit ou bien qui le propose, veuillez contacter cette personne en direct.

7. Autres informations pertinentes

Catégorie SFDR : Article 6.

Assurance Vie : Lorsque ce produit est utilisé comme support en unité de compte d'un contrat d'assurance sur la vie ou de capitalisation, les informations complémentaires sur ce contrat, telles que les coûts du contrat, qui ne sont pas compris dans les coûts indiqués dans le présent document, le contact en cas de réclamation et ce qui se passe en cas de défaillance de l'entreprise d'assurance sont présentées dans le document d'informations clés de ce contrat obligatoirement remis par votre assureur ou courtier ou tout autre intermédiaire d'assurance conformément à son obligation légale.