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 SERENITY EURO - UCITS ETF 1C (EUR)

Nombre del promotor del fondo : Ossiam
ISIN : LU2898088419

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 : 31/08/2026

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, tras deducir las comisiones y gastos del Fondo, el rendimiento del nivel de cierre del índice Solactive €STR T+1 Settlement Daily Total Return Index (en lo sucesivo, el «Índice»). El índice Solactive €STR T+1 Settlement Daily Total Return Index refleja el rendimiento de un depósito que devenga intereses al tipo de interés a corto plazo del euro (€STR), reinvirtiéndose los intereses en el depósito. El índice Solactive €STR T+1 Settlement Daily Total Return Index es administrado por Solactive AG y se calcula cualquier día que sea (o, salvo que se produzca una perturbación del mercado, hubiera sido) un día (que no sea sábado o domingo) que no sea festivo según el calendario Target 2. 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 de mercado es de hasta un 0,50 % en un periodo de un año.

Política de inversión : Para alcanzar su objetivo de inversión, el Fondo utilizará principalmente swaps con el objetivo de replicar el rendimiento del Índice mediante réplica sintética. El Fondo invertirá en una cartera de activos cuyo rendimiento o valor se intercambiará por el rendimiento o el valor del Índice o su tipo subyacente, mediante acuerdos de swap con una o varias contrapartes de swap. Los contratos de swap permitirán al Fondo, teniendo en cuenta su cartera de activos, obtener en cualquier momento, en caso de solicitud de reembolso, un importe que le permita alcanzar su objetivo de inversión. Por lo tanto, el Fondo ya no tendrá ninguna exposición a la cartera de activos. 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 y de su tipo subyacente. Las contrapartes de los swaps serán entidades financieras de primera clase especializadas en este tipo de operaciones y con una calificación mínima de grado de inversión. Puede existir un contrato de licencia del índice entre la(s) contraparte(s) del swap y el Proveedor del Índice; por lo tanto, los costes de licencia pueden estar incluidos en los costes del swap. El Fondo solo invertirá en acciones, derechos o bonos emitidos por empresas con domicilio social en países de la OCDE, o en bonos emitidos por gobiernos de la OCDE. Los bonos emitidos por empresas tendrán una calificación mínima equivalente al grado de inversión. Además, y de forma accesoria, el Fondo podrá invertir en efectivo e instrumentos equivalentes al efectivo. Las inversiones en equivalentes de efectivo autorizadas son fondos del mercado monetario de conformidad con el Reglamento (UE) 2017/1131 sobre los fondos del mercado monetario, depósitos a plazo con contrapartes bancarias que tengan como mínimo grado de inversión y un vencimiento residual inferior a 92 días en el momento de la inversión, o emisiones de deuda soberana a tipo fijo que tengan como mínimo grado de inversión y un vencimiento residual inferior a 92 días en la fecha de la inversión. A nivel del Fondo, la sensibilidad al tipo de interés y al crédito se situará entre 0 y 0,5. No se espera que la volatilidad del Fondo se desvíe significativamente de la de su Índice. La moneda de referencia del Fondo es el euro.

Asignación de sumas distribuibles : Capitalización.

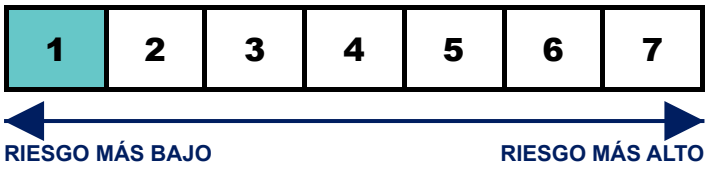
Dirigido a inversores minoristas : El Fondo está destinado a inversores minoristas con capacidad para soportar pérdidas hasta el importe invertido en el Fondo.

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 1 mes. El riesgo real puede ser muy diferente si decide salir antes del vencimiento, y es posible que obtenga un rendimiento menor. El indicador de riesgo muestra el nivel de riesgo de este producto en comparación con otros. Indica la probabilidad de que este producto sufra pérdidas en caso de movimientos del mercado o de que no podamos pagarle.

Hemos clasificado el Fondo en la clase de riesgo 1, que es la clase de riesgo más baja. En otras palabras, las pérdidas potenciales vinculadas a la rentabilidad futura del producto son muy bajas y, si las condiciones del mercado se deterioran, es muy poco probable que nuestra capacidad para pagarle se vea afectada. El riesgo de liquidez del mercado puede acentuar las variaciones en el rendimiento del producto.

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, 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 mes (período de mantenimiento recomendado)
Escenario de tensión	**Lo que puede recibir una vez deducidos los costes**	EUR 9 989
	Rendimiento medio cada año	-1,34%
Escenario Desfavorable	**Lo que puede recibir una vez deducidos los costes**	EUR 9 995
	Rendimiento medio cada año	-0,63%
Escenario Moderado	**Lo que puede recibir una vez deducidos los costes**	EUR 10 021
	Rendimiento medio cada año	2,48%
Escenario Favorable	**Lo que puede recibir una vez deducidos los costes**	EUR 10 037
	Rendimiento medio cada año	4,45%

Escenario Desfavorable:
Este tipo de escenario ocurrió para una inversión entre 29/04/2022 y 31/05/2022

Escenario Moderado:
Este tipo de escenario ocurrió para una inversión entre 30/09/2025 y 31/10/2025

Escenario Favorable:
Este tipo de escenario ocurrió para una inversión entre 29/03/2024 y 30/04/2024

3. ¿ Qué pasa si la sociedad de gestión no puede pagar ?

El producto es una copropiedad de instrumentos financieros y depósitos independiente de la sociedad gestora de carteras. En caso de incumplimiento por parte de la sociedad gestora de la cartera, los activos del producto en poder del depositario no se verán afectados. En caso de incumplimiento por parte 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 asesore sobre este Fondo puede pedirle que pague costes adicionales. En tal caso, le informará de dichos costes y le explicará cómo afectan a su inversión.

Costes a lo largo del tiempo

	Costes totales	Impacto sobre la reducción del rendimiento por año*
Si reembolsa después de 1 mes	EUR 1	0,18%

Los cuadros muestran los importes deducidos de su inversión para cubrir los distintos tipos de gastos. Estos importes dependen del importe que invierta, del tiempo que mantenga el producto y de la rentabilidad del mismo. 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 en el primer año recuperaría el importe invertido (0% de rentabilidad anual). Que para los demás periodos de tenencia, el producto evoluciona como se indica en el escenario intermedio.
• Se invierten 10.000 euros

*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 2,66% antes de los costes y 2,48% 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.

			Si reembolsa después de 1 mes
Costes únicos	**Costes de entrada***	Hasta el 0,00% del importe que paga al iniciar la inversión.	EUR 0
	Costes de salida*	Hasta el 0,00% del importe que paga al salir de la inversión.	EUR 0
Costes corrientes	**Costes de operación de la cartera**	0,00% del valor de su inversión por año.	EUR 0
	Otros costes corrientes	0,15% del valor de su inversión por año.	EUR 1
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 tenencia recomendado: 1 mes

Este producto no tiene un periodo mínimo de mantenimiento recomendado, pero está diseñado para inversiones a muy corto plazo. Cualquier inversión debe considerarse sobre la base de sus necesidades específicas de inversión y apetito de riesgo. Ossiam no garantiza la idoneidad o adecuación de esta inversión a sus circunstancias personales. Si tiene alguna duda sobre la idoneidad de este producto para sus necesidades, le aconsejamos que busque asesoramiento profesional. Puede comprar o vender diariamente sus ETFs en el mercado secundario a través de un intermediario en la(s) bolsa(s) en la(s) que cotizan los ETFs.

Procesamiento de solicitudes :

Las órdenes de suscripción y reembolso se reciben a más tardar a las 14.00 horas (hora de Luxemburgo). Para más información, consulte el Folleto y/o póngase en contacto con su agente de bolsa.

6. ¿Cómo puedo reclamar ?

Puede presentar una reclamación sobre el producto o la conducta de (i) la Sociedad Gestora (ii) una persona que asesore sobre el producto, o (iii) una persona que venda el producto enviando un correo electrónico o una carta a las siguientes personas, según proceda:
• 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 en 36 rue Brunel, 75017, París (Francia) o por correo electrónico a info@ossiam.com. En la página 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 8.

Seguro de vida : Cuando este producto se utiliza como unit-linked 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 expuestos en este documento, el contacto en caso de siniestro y lo que ocurre si la compañía de seguros incumple, figura en el documento de datos fundamentales de este contrato, que debe facilitarle su asegurador o corredor o cualquier otro mediador de seguros de conformidad con su obligación legal.

Instrumentos de gestión de la liquidez : El Producto cuenta con un mecanismo de bloqueo de reembolso («Gates») y con instrumentos de protección contra la dilución (gravamen de protección contra la dilución o ajuste parcial o total del valor liquidativo) para mitigar una dilución significativa para los inversores restantes.