

# Datos fundamentales para el inversor

El presente documento recoge los datos fundamentales sobre este Fondo que el inversor debe conocer. No se trata de material de promoción comercial. La ley exige que se facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del Fondo y los riesgos que comporta invertir en él. Es aconsejable que lea el documento para poder tomar una decisión fundada sobre la conveniencia o no de invertir en él.



## OSTRUM SRI EURO AGGREGATE

es un subfondo de NATIXIS AM FUNDS (la «SICAV»).

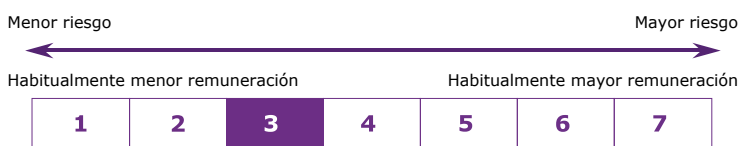
I/A (EUR) ISIN LU0935223387 - I/D (EUR) ISIN LU0935223460

Natixis Investment Managers International forma parte del Grupo BPCE y es la Sociedad Gestora del Fondo.

### OBJETIVOS Y POLÍTICA DE INVERSIÓN

- El objetivo de inversión del Ostrum SRI Euro Aggregate (el «Subfondo») es superar la rentabilidad de su índice de referencia, el Bloomberg Capital Euro Aggregate 500MM, durante el periodo de inversión mínimo recomendado de 2 años, mediante inversiones en una amplia gama de instrumentos de renta fija que cumplan con criterios extrafinancieros (ambientales, sociales y de gobernanza).
- El Subfondo se gestiona de forma activa. A título meramente indicativo, la rentabilidad del Subfondo podrá compararse con la del Índice de referencia. En la práctica, es probable que la cartera del Subfondo incluya componentes del Índice de referencia, pero el Gestor de inversiones tiene plena discreción para seleccionar los valores que componen la cartera siempre y cuando respete los límites dispuestos en la política de inversión del Subfondo. Sin embargo, no tiene por objeto reproducir dicho Índice de referencia y, por lo tanto, puede desviarse significativamente del mismo.
- El Subfondo invierte su patrimonio neto principalmente en emisiones de crédito con grado de inversión (Investment Grade) denominado en euros y bonos soberanos, así como en títulos emitidos por agencias y «covered bonds». El Subfondo se gestiona de forma activa y se basa en la experiencia del Gestor delegado de inversiones en los mercados de renta fija y de divisas:
  - Una asignación fundamental entre emisiones soberanas, cuasisoberanas, titulizadas y de crédito.
  - Inversiones sin índice de referencia, basadas en la evaluación fundamental y global del riesgo y la remuneración por parte del Gestor delegado de inversiones.
  - Un proceso de selección que integra factores y criterios financieros y ESG, para seleccionar emisiones específicas de bonos, incluidos los bonos sostenibles, en cada clase de activos principales.
  - Diversificación de la inversión en instrumentos de tipos, divisas y distintas estrategias de crédito.
- El Subfondo está expuesto a títulos de renta fija denominados en euros en todo momento. El Subfondo invierte al menos un 70 % de su patrimonio neto en emisiones de crédito con grado de inversión (Investment Grade) denominado en euros y bonos soberanos, así como en títulos emitidos por agencias y «covered bonds». A efectos de diversificación y con vistas a optimizar la rentabilidad ajustada al riesgo, el Subfondo podrá invertir en las siguientes clases de activos:
  - Instrumentos del mercado monetario.
  - Bonos vinculados a la inflación.
  - Bonos de tipo variable.
  - Los emisores soberanos se limitan al 70 % (no incluidos los bonos verdes de emisores soberanos).
  - Titulizaciones (como valores respaldados por activos, valores respaldados por hipotecas, obligaciones de deuda con garantía y obligaciones de préstamo con garantía), hasta el 20 % de su patrimonio neto. Estos valores deberán ostentar la calificación de grado de inversión (Investment Grade).
  - Bonos emitidos por miembros de la OCDE no denominados en euros;
  - Bonos no denominados en euros;
  - Bonos convertibles: hasta un 15 % de su patrimonio neto;
  - High Yield, «bonos de alto rendimiento»: hasta un 15 % de su patrimonio neto;
  - Bonos de mercados emergentes: hasta un 15 % de su patrimonio neto;
  - Bonos convertibles contingentes: hasta un 5 % de su patrimonio neto.El Subfondo podrá invertir en otras divisas distintas de la divisa de referencia hasta el 10 % de su patrimonio neto. La exposición global del Subfondo a la renta variable no superará el 10 % de su patrimonio neto. La exposición global de Subfondo a los valores no denominados en euros y al riesgo de tipo de cambio no superará el 10 % de su patrimonio neto. La duración modificada de la cartera puede oscilar entre 0 y 10.
- El Subfondo podrá utilizar derivados con fines de cobertura e inversión.
- Los ingresos percibidos por el Subfondo se reinvierten en el caso de las Acciones de acumulación y se distribuyen en el caso de las Acciones de distribución.
- Los Accionistas podrán reembolsar sus Acciones, previa solicitud, en cualquier día hábil tanto de Francia como de Luxemburgo antes de las 13:30 horas.

### PERFIL DE RIESGO Y REMUNERACIÓN



- Se ha asignado al Subfondo una categoría en la escala de indicación sintética de riesgo y remuneración, debido a su exposición a mercados de renta fija de la zona euro.
- Los datos históricos pueden no constituir una indicación fiable de la evolución futura.
- La categoría de riesgo indicada no puede garantizarse y puede variar a lo largo del tiempo. No puede garantizarse el capital ni existe protección sobre el valor del Subfondo.
- La asignación a la categoría más baja no significa que la inversión esté libre de riesgo.

**Cabe la posibilidad de que el indicador de riesgo y remuneración no capte totalmente los riesgos que se citan a continuación:**

- Riesgo de crédito: el riesgo de crédito surge debido al riesgo de deterioro de la calidad de un emisor y/o una emisión, lo que podría implicar una pérdida de valor del título. También puede producirse en casos de impago al vencimiento por parte de un emisor en la cartera.

La sección «Riesgos principales» del Folleto recoge otros riesgos de inversión.

## GASTOS DEL FONDO

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión:

Gastos de entrada	Ninguna
Gastos de salida	Ninguna

Este es el máximo que puede detrarse de su capital antes de proceder a la inversión y/o antes de abonar el producto de su inversión.

Le rogamos consulte con su asesor financiero o el distribuidor para conocer los gastos reales.

Gastos detrados del Fondo a lo largo de un año:

Gastos corrientes	0,61 %
-------------------	--------

Gastos detrados del Fondo en determinadas condiciones específicas:

Comisión de rentabilidad	Ninguna
--------------------------	---------

Los gastos que usted soporta están destinados a sufragar los costes de funcionamiento del Fondo, incluidos los costes de comercialización y distribución. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de su inversión.

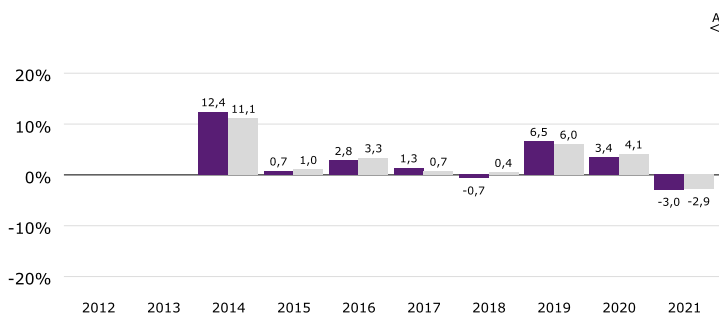
La cifra de gastos corrientes se basa en los gastos del ejercicio cerrado a junio de 2021. Dicha cifra puede variar de un año a otro.

Los gastos corrientes no incluyen lo siguiente:

- Comisiones de rentabilidad.
- Costes de transacción de la cartera, excepto en caso de que el Fondo pague gastos de entrada o de salida cuando compre o venda participaciones de otro organismo de inversión colectiva.

Si desea más información acerca de los gastos, consulte la sección «Comisiones y Gastos» del Folleto, que se encuentra disponible en [www.im.natixis.com](http://www.im.natixis.com).

## RENTABILIDAD HISTÓRICA



■ I/A (EUR) e I/D (EUR)  
■ Índice de referencia

A\*: 12/12/2021: integración de los criterios ESG en el proceso de inversión.

- El Subfondo se creó en 2013.
- Las Clases de participaciones I/A (EUR) e I/D (EUR) se crearon en 2013.
- El gráfico de rentabilidad mostrado no constituye una indicación fiable de la rentabilidad futura.
- La rentabilidad anual se calcula una vez deducidos los costes aplicados por el Subfondo.
- Divisa: Euro.
- La rentabilidad del Subfondo no está vinculada a la del índice de referencia. El índice de referencia debe utilizarse como un comparador.

## INFORMACIÓN PRÁCTICA

- El Subfondo mantiene sus activos depositados en CACEIS Bank, Luxembourg Branch. Los activos y los pasivos de cada subfondo están segregados. Por tanto, los derechos de inversores y acreedores relativos a un subfondo se limitan a los activos de ese subfondo, a menos que se indique lo contrario en los documentos de constitución de la SICAV.
- Puede obtenerse, sin coste alguno, información adicional acerca del Subfondo, incluido el Folleto vigente, los estados financieros más recientes y los últimos precios de las acciones del Subfondo, así como información de otras clases de acciones y las distintas versiones de este documento en otros idiomas, en [www.im.natixis.com](http://www.im.natixis.com) o en el domicilio social de la Sociedad Gestora.
- Puede encontrar más información acerca de la política de remuneración en [www.im.natixis.com](http://www.im.natixis.com) y existen copias impresas disponibles de forma gratuita previa solicitud.
- Fiscalidad: Dependiendo de cuál sea su país de residencia, esto podría incidir sobre su inversión. Si desea obtener más información, contacte con un asesor.
- Natixis Investment Managers International únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes con respecto a las correspondientes partes del Folleto del Subfondo.