

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 et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d'autres produits.

Date de production: 01.01.2023

OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR

UCITS ETF 1C (EUR) | ISIN: LU1079841273

Société de gestion: Ossiam, une société du groupe Natixis · Régulateur: Autorité des Marchés Financiers (AMF) · Contact: www.ossiam.com | +33 1 84 79 42 70

Ce produit est autorisé au Luxembourg et est réglementé par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) en ce qui concerne ce document d'informations clés.

1. En quoi consiste ce produit?

Type: Le Fonds est un OPCVM ETF géré de manière passive. La Classe d'Actions 1C (EUR) étant une classe de capitalisation, les revenus tirés du Fonds sont réinvestis.

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

Objectifs: Le fonds OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR (ci après «le Fonds») vise à répliquer, hors frais et dépenses, la performance de l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR, mesurée par son cours de clôture. Ce Fonds est géré passivement. L'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR («l'Indice») est un indice de capitalisation (réinvestissement des dividendes nets) promu par Barclays (le « Fournisseur d'Indice ») et calculé et publié par Bloomberg Index Services Limited («l'Agent de calcul»). Il est exprimé en dollars américains (USD). L'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR reflète la performance d'une exposition longue dynamique à quatre secteurs d'actions américaines choisis chaque mois en fonction de leur CAPE® relatif (PER corrigé des variations cycliques) et des variations de cours des 12 mois précédents («momentum des cours sur 12 mois»). L'exposition aux secteurs d'actions américaines se fait par le biais des indices sectoriels S&P Select («les Sous-indices»), qui reflètent la performance des sociétés américaines incluses dans l'indice S&P 500. Les composantes sectorielles de l'Indice sont sélectionnées chaque mois selon la méthodologie de la série d'indices Shiller Barclays CAPE®. Chacun des sous indices choisis reçoit la même pondération lors de chaque rééquilibrage. Pour une description détaillée de l'Indice, voir la section «Description de l'Indice» de l'annexe consacrée au Fonds dans le Prospectus

Politique d'investissement: Afin de réaliser son objectif d'investissement, le Fonds utilise principalement des swaps afin de suivre la performance de l'Indice par le biais d'une réplication synthétique. Dans cette optique, le Fonds investit dans un portefeuille d'actifs dont la performance est échangée contre celle de l'Indice, d'un indice associé ou d'un portefeuille de ses composantes, par l'intermédiaire d'un contrat de swap conclu avec une contrepartie de swap. Cette méthode engendre un risque de contrepartie, comme défini à la section «Profil de risque et de rendement» ci-dessous. En conséquence, la valeur d'inventaire nette par action du Fonds augmente (ou diminue) en fonction des variations de l'Indice. La contrepartie de swap doit être un établissement financier de premier ordre spécialisé dans ce type d'opération. Le Fonds peut conclure de multiples contrats de swap, auprès de contreparties ayant les mêmes caractéristiques susmentionnées. Le Fonds peut, dans le respect des intérêts de ses Actionnaires, passer, partiellement ou totalement, de l'une à l'autre des politiques d'investissement ci-dessus (réplication synthétique ou physique). Dans le cadre des deux stratégies de réplication, le Fonds doit en permanence investir au moins 60% de ses actifs en actions ou droits émis par des sociétés dont le siège social est sis dans les pays de l'OCDE

Instruments dérivés et technique d'investissement: En outre, à titre accessoire, le Fonds peut utiliser d'autres instruments dérivés à des fins de couverture et d'investissement et effectuer des opérations de prêt et d'emprunt de titres, ainsi que des opérations de pension, comme indiqué dans la section «Recours aux instruments dérivés, techniques d'investissement et de couverture spéciales» du Prospectus

Catégorie SFDR: Article 6

Investisseur de détail visés: Les investisseurs qui comprennent les risques du Fonds et prévoient d'investir à long terme. Le Fonds peut s'adresser aux investisseurs qui : (i) recherchent un investissement axé sur la croissance, (ii) sont intéressés par une exposition aux marchés d'actions américains, soit pour un investissement de base, soit à des fins de diversification, (iii) ont un profil de risque élevé et peuvent tolérer des pertes importantes.

Devise de référence: EUR

Traitement des ordres: Les Actions UCITS ETF 1C(EUR) sont cotées sur une ou plusieurs places boursières. Les investisseurs peuvent acheter et vendre leurs Actions soit par l'intermédiaire de leur courtier habituel, lors de tout jour de bourse de la ou des place(s) boursière(s) concernée(s) qui est également un jour de transaction, soit par l'intermédiaire d'une plate-forme de distribution de fonds. Veuillez contacter votre courtier pour des informations complémentaires. La Classe d'Actions UCITS ETF 1C(EUR) étant une classe de capitalisation, les revenus tirés du Fonds sont réinvestis. Pour de plus amples renseignements, veuillez lire la section intitulée «Souscription, transfert, conversion et rachat d'Actions» et la section intitulée «Informations pratiques» de l'annexe consacrée au Fonds dans le Prospectus.

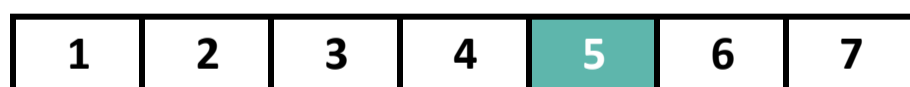
Heure limite de réception des ordres: 16h00 (heure du Luxembourg)

Dépositaire: State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch

Agent administratif: State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch

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

Indicateur de risque



RISQUE LE PLUS FAIBLE

RISQUE LE PLUS ÉLEVÉ



L'indicateur de risque suppose que vous conservez ce produit pendant **au moins 5 ans**. Vendre avant la fin de cette période accroît fortement le risque de baisse des rendements des investissements ou de perte.

La Catégorie d'actions est classée au niveau 5 sur l'échelle synthétique de l'indicateur de risque, qui repose sur des données historiques. En raison de son exposition aux marchés d'actions, le Fonds pourra subir une volatilité importante, que son classement dans l'indicateur susmentionné reflète. Les données historiques peuvent ne pas constituer un indicateur fiable de la performance future. La catégorie de risque indiquée n'est pas garantie et peut évoluer. Il n'existe aucune garantie du capital ni de protection sur la valeur du Fonds. Vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement. La catégorie inférieure n'est pas synonyme d'« absence de risque ».

Considérations spéciales sur les risques

Risque lié à l'indice: la valeur des Actions du Fonds est liée à celle de l'Indice, qui peut augmenter ou diminuer. En conséquence, l'attention des investisseurs est attirée sur le fait que la valeur de leurs placements peut augmenter ou diminuer. En outre, il est impossible de garantir que la méthodologie sous-jacente de l'Indice permettra de dégager un rendement supérieur à celui de toute autre stratégie d'investissement comparable ou que les investisseurs récupéreront leur investissement initial.

Risque lié à la concentration géographique: le Fonds effectuant des opérations de swap, il s'expose potentiellement au risque de contrepartie et d'émetteur. En cas d'insolvabilité ou de défaillance de la contrepartie ou de l'émetteur, le Fonds peut subir une perte. La valeur des opérations de swap peut varier en fonction de facteurs divers, incluant (sans s'y limiter) le niveau

Risque lié aux instruments dérivés et aux contreparties: le Fonds, qui concentre ses placements dans certaines régions peut encourir des pertes, notamment si l'économie de la région concernée subit des difficultés ou si les investissements deviennent moins attrayants dans cette région. En outre, les marchés sur lesquels le Fonds investit peuvent être affectés de manière significative par des conditions politiques, économiques ou réglementaires défavorables.

Attention au risque de change. Si les sommes qui vous seront versées le sont dans une autre monnaie, votre gain final dépendra du taux de change entre les deux monnaies. Ce risque n'est pas pris en compte dans l'indicateur ci-dessus.

Veuillez lire la section du Prospectus intitulée «Risques généraux» pour de plus amples renseignements sur les risques.

Scénarios de performance

		1 an	5 ans (période de détention recommandée)
Scénario de Tension	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	EUR 3 981	EUR 746
	Rendement annuel moyen	-60.2%	-40.5%
Scénario Défavorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	EUR 9 030	EUR 14 225
	Rendement annuel moyen	-9.7%	7.3%
Scénario Intermédiaire	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	EUR 10 944	EUR 17 511
	Rendement annuel moyen	9.4%	11.9%
Scénario Favorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	EUR 15 212	EUR 25 210
	Rendement annuel moyen	52.1%	20.3%

Ce tableau montre l'argent que vous pourriez récupérer au cours des 5 prochaines années, selon différents scénarios, en supposant que vous investissez 10 000,00 EUR. Les scénarios présentés illustrent la performance de votre investissement. Vous pouvez les comparer aux scénarios d'autres produits. Les scénarios présentés sont une estimation des performances futures fondée sur des preuves passées de la manière dont la valeur de cet investissement varie et peuvent inclure des données d'indice(s) de référence/d'indicateur de proximité, au cours des dix dernières années. Les marchés pourraient évoluer très différemment. Ce que vous obtenez variera en fonction des performances du marché et de la durée de conservation du produit. Le scénario de tensions montre ce que vous pourriez récupérer dans des circonstances de marché extrêmes, et il ne tient pas compte de la situation où nous ne sommes pas en mesure de vous payer. Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du produit lui-même, mais peuvent ne pas inclure tous les frais que vous réglez à votre courtier, conseiller financier ou distributeur. Les chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, ce qui peut également avoir une incidence sur le montant de votre récupération.

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

Les actifs du Fonds sont juridiquement séparés de ceux d'Ossiam. Si le Fonds n'est pas en mesure d'effectuer les paiements (notamment en raison de son insolvabilité), vous pourriez subir une perte financière. State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg a été désignée comme le dépositaire du Fonds (le « Dépositaire »). L'investisseur peut subir une perte financière en raison de la défaillance du Dépositaire agissant en qualité de dépositaire du Fonds conformément à la Directive OPCVM 2009/65/CE. Il existe un risque potentiel de responsabilité pour le Dépositaire en cas de perte des actifs du Fonds. Le Dépositaire est responsable en cas de négligence ou de manquement intentionnel du Dépositaire à remplir ses obligations conformément à la Directive OPCVM 2009/65/CE. Les pertes ne sont couvertes par aucun système d'indemnisation ou de garantie des investisseurs.

4. Que va me coûter cet investissement?

La personne qui vous vend ou vous conseille sur ce produit peut vous facturer d'autres frais. Dans l'affirmative, cette personne vous fournira des informations sur ces coûts et vous montrera l'impact que tous les coûts auront sur votre investissement dans le temps.

La réduction du rendement (RIY) montre l'impact des coûts totaux que vous payez sur le rendement de l'investissement que vous pourriez obtenir. Les coûts totaux tiennent compte des coûts ponctuels, courants et accessoires.

Coût au fil du temps

	Coûts totaux	Réduction du rendement par an*
Si vous sortez après 1 an	EUR 873	8.7%
Si vous sortez après la période de détention recommandée	EUR 1495	2.8%

Les coûts présentés dans ce tableau représentent le montant attendu des coûts du produit qui affecteraient votre rendement, en supposant que:

- (i) pour la première année, vous récupérez le montant que vous avez investi (soit un rendement annuel de 0%)
- (ii) pour les autres périodes de détention, le Produit évolue de la manière indiquée dans le scénario intermédiaire
- (iii) vous avez investi 10,000 EUR

*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 14.7% avant déduction des coûts et de 11.9% 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 4.00% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement.	EUR 400
	Coûts de sortie	Jusqu'à 4.00% du montant que vous payez au moment de la sortie dans l'investissement.	EUR 400
Coûts récurrents	Coûts de transaction	0% 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 surperformance pour ce produit.	---
	Commissions d'intéressement	Il n'y a pas de commission d'intéressement pour ce produit.	---

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 minimale de détention recommandée requise (RHP), mais il est destiné à un investissement à long terme. Tout investissement doit être considéré au regard de vos besoins d'investissement spécifiques et de votre propension au 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 demander conseil à 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.

6. Comment puis-je formuler une réclamation?

Vous pouvez envoyer un courriel à info@ossiam.com ou par courrier à l'adresse suivante: Ossiam, 36 rue Brunel, 75017, Paris, France. La politique complète en matière de traitement des réclamations est disponible à l'adresse www.ossiam.com.

7. Autres informations pertinentes

Informations ESG pré-contractuelles: Le Fonds ne promeut pas des caractéristiques environnementales et/ou sociales et n'a pas pour objectif l'investissement durable (article 6 du règlement SFDR).

Informations fiscales et de pertinence: Contactez votre conseiller ou distributeur.

Performances passées: Rendez-vous sur www.ossiam.com. Veuillez noter que la performance passée ne préjuge pas des rendements futurs.

Autres informations: Le dernier prospectus, les rapports annuel/semestriel, la valeur liquidative et d'autres informations sur les produits sont disponibles gratuitement sur www.ossiam.com

