

Dieses Informationsblatt stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und Ihnen dabei zu helfen es mit anderen Produkten zu vergleichen.

Stand: 01.01.2023

Ossiam Short Term Interest Rates Carry

1A (EUR) | ISIN: IE00BNDMJ843

Verwaltungsgesellschaft: Ossiam, ein Unternehmen der Natixis-Gruppe · Regulator: Autorité des Marchés Financiers (AMF) · Kontakt: www.ossiam.com | +33 1 84 79 42 70

Dieses Produkt ist in Irland zugelassen und unterliegt hinsichtlich dieses Basisinformationsdokuments der Aufsicht der Central Bank of Ireland.

1. Um welche Art von Produkt handelt es sich?

Art: Der Fonds ist ein aktiv verwalteter OGAW. Die Anteilsklasse 1A (EUR) ist eine thesaurierende Anteilsklasse, d.h. aus dem Fonds erzielte Erträge werden reinvestiert.

Verfall: Für dieses Produkt ist keine bestimmte Verfallszeit vorgesehen. In diesem Fall werden Sie auf geeignete, gesetzlich vorgeschriebene Weise darüber informiert.

Ziele: Ziel des Fonds ist es, den potenziellen positiven Carry bei kurzfristigen Zinsfutures zu nutzen. Der Fonds wird aktiv ohne Bezugnahme auf einen Referenzwert verwaltet. Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der Fonds die systematische Anlagestrategie der Verwaltungsgesellschaft (die „Anlagestrategie“) um, die darauf abzielt, durch die potenzielle Ausnutzung der Terminkursverzerrung bei Zinssätzen und Zinsänderungszyklen Renditen zu erzielen. Der Fonds strebt Long- und/oder Short-Engagements in 3-monatigen Zinsfutures an (wobei mit Long-Futures auf einen Rückgang der zugrunde liegenden Zinsniveaus gesetzt wird und umgekehrt). Die Futures werden auf bedeutende Währungen (z. B. EUR und USD) lauten und anhand quantitativer Indikatoren ausgewählt werden, die von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden. Diese Indikatoren können für jeden Kontrakt unter anderem Folgendes umfassen: (i) den „Carry“, d.h. die Differenz zwischen dem Preis des Futures und dem vorher auslaufenden Kontrakt; (ii) den „Trend“, d. h. seine jüngste historische Wertentwicklung; und - die „Volatilität“, d.h. die Standardabweichung seiner früheren Renditen. Typischerweise zielt die Anlagestrategie bei umfangreichen Carry Gelegenheiten auf eine Long-Position in Futures ab und sie zielt auf eine Short Position ab, wenn die Anlagestrategie einen Zinsanstieg erwartet. Es besteht keine Mindestanlage in Long- oder Short-Positionen. Die Anlagestrategie zielt darauf ab, das Engagement über Futures mit verschiedenen Fälligkeitsterminen und Währungen zu diversifizieren. Die Verwaltungsgesellschaft wird die Verwendung der Indikatoren regelmäßig überprüfen und kann zu diesem Zweck (i) neue Marktbedingungen, (ii) die Verfügbarkeit und Liquidität von Zinsfutures und (iii) den wirtschaftlich effizientesten Weg zur Erreichung des gewünschten Engagements berücksichtigen. Der Fonds kann in erheblichem Umfang in derivative Instrumente wie Swaps, Futures, Devisenterminkontrakte investieren, tätigt jedoch keine Wertpapierleih-, Pensions- oder umgekehrten Pensionsgeschäfte. Der Fonds kann bis zu 100 % seines Vermögens in liquiden Vermögenswerten (wie Einlagen, Commercial Paper, fest- oder variabel verzinsliche Anleihen, die von OECD-Mitgliedstaaten oder deren Gebietskörperschaften oder von supranationalen Organisationen und Institutionen mit einem hohen Rating begeben oder garantiert werden) halten, um die Margin-Verpflichtungen zu unterstützen, die sich aus seiner Anlage in derivative Finanzinstrumente ergeben.

Anlagepolitik: Der Fonds kann bis zu 100 % seines Vermögens in liquiden Vermögenswerten (wie Einlagen, Commercial Paper, fest- oder variabel verzinsliche Anleihen, die von OECD-Mitgliedstaaten oder deren Gebietskörperschaften oder von supranationalen Organisationen und Institutionen mit einem hohen Rating begeben oder garantiert werden) halten, um die Margin-Verpflichtungen zu unterstützen, die sich aus seiner Anlage in derivative Finanzinstrumente ergeben. Der Fonds kann auch bis zu maximal 10 % seines Nettoinventarwerts in andere regulierte, offene Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich ETFs) investieren, wenn die Ziele dieser Fonds mit dem Ziel des Fonds vereinbar sind.

Derivaten und Sicherungstechniken: Da der Fonds der Anlagestrategie ausgesetzt ist, wird im Allgemeinen davon ausgegangen, dass die Hebelung des Fonds (d. h. das durch den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten erzielte Anlageengagement) zwischen 0 und 1.000 % seines Nettoinventarwerts liegt. Der Fonds kann eine höhere Hebelung aufweisen, insbesondere in Zeiten abnormaler und/oder ungünstiger Marktbedingungen, wobei jedoch nicht mit einer Hebelung von mehr als 1.100 % gerechnet wird. Das Gesamtengagement des Fonds wird nach der absoluten VaR-Methode überwacht und verwaltet.

SFDR Kategorie: Artikel 6

Kleinanleger-Zielgruppe: Anleger, die Risiken des Fonds verstehen und eine langfristige Anlage planen. Der Fonds ist unter Umständen für Anleger geeignet, die: (i) eine wachstumsorientierte Anlage im Rahmen eines nachhaltigen Anlageansatzes anstreben, (ii) an einem Engagement auf den europäischen Aktienmärkten interessiert sind, entweder als Kerninvestition oder zu Diversifizierungszwecken, (iii) ein hohes Risikoprofil haben und erhebliche Verluste in Kauf nehmen können.

Referenzwährung: EUR

Bearbeitung von Anträgen: Investors may subscribe or redeem shares on any Dealing Day in Ireland.

Handelsfrist: 11 Uhr (Ortszeit Irland) am Handelstag

Verwahrstelle: The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch

Verwaltungsstelle: BNY Mellon Fund Services (Ireland) DAC

2. Welche Risiken bestehen und was könnte ich im Gegenzug dafür bekommen?

Risikoindikator



Der Risikoindikator basiert auf der Annahme, dass Sie dieses Produkt **mindestens 5 Jahre** lang behalten. Ein Verkauf vor Ablauf dieses Zeitraums erhöht das Risiko geringerer Anlagerenditen oder eines Verlusts erheblich.

Die Anteilsklasse ist auf der synthetischen Risikoindikatorkala, die auf historischen Daten basiert, in die Kategorie 2 eingestuft. Aufgrund seines Engagements an den Aktienmärkten kann der Fonds eine erhebliche Volatilität verzeichnen, was sich in der Einstufung auf der obigen Skala niedergeschlagen hat. Daten aus der Vergangenheit sind möglicherweise kein zuverlässiger Hinweis auf die Zukunft. Die angegebene Risikokategorie ist nicht garantiert und kann sich im Laufe der Zeit ändern. Es besteht keine Kapitalgarantie und kein Schutz in Bezug auf den Wert des Fonds. Die niedrigste Kategorie bedeutet nicht, dass die Anlage risikofrei ist. Sie könnten Ihre Investition ganz oder

Spezielle Risikoerwägungen

Indexrisiko: Der Fonds kann eine Hebelung erzielen, wenn derivative Finanzinstrumente eingesetzt werden. Gehebelte Produkte verstärken sowohl Gewinne als auch Verluste um einen bestimmten Hebelfaktor. Verluste können daher potenziell erheblich sein.

Derivate- und Kontrahentenrisiko: Der Fonds kann in erheblichem Umfang in derivative Finanzinstrumente investieren, und der Fonds kann aufgrund der Nichterfüllung der Bedingungen des Derivatekontrakts durch die Gegenpartei einen Verlust erleiden. Weitere Einzelheiten zu den damit verbundenen Risiken entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Risiken in Verbindung mit Derivaten“ im Verkaufsprospekt.

Kreditrisiko: Der Fonds kann in festverzinsliche Instrumente investieren, und der Fonds kann einen Verlust erleiden, wenn der Emittent der festverzinslichen Instrumente seinen Tilgungsverpflichtungen nicht nachkommt. Weitere Einzelheiten zu den damit verbundenen Risiken entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Risiken in Verbindung mit Derivaten“ im Verkaufsprospekt.

Achten Sie auf das Wechselkursrisiko. Wenn Sie in einer anderen Währung bezahlt werden, hängt Ihr endgültiger Gewinn vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen ab. Dieses Risiko ist in dem oben genannten Indikator nicht berücksichtigt.

Weitere Einzelheiten zu den Risiken entnehmen Sie bitte dem Nachtrag und dem Verkaufsprospekt für den OSSIAM IRL ICAV (der „Verkaufsprospekt“).

Performance-Szenarien

		1 Jahr	3 Jahre (Empfohlene Haltedauer)
Stressszenario	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten	EUR 7 360	EUR 7 385
	Jährliche Durchschnittsrendite	-26.4%	-9.6%
Pessimistisches Szenario	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten	EUR 8 836	EUR 8 954
	Jährliche Durchschnittsrendite	-11.6%	-3.6%
Mittleres Szenario	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten	EUR 10 054	EUR 10 435
	Jährliche Durchschnittsrendite	0.5%	1.4%
Optimistisches Szenario	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten	EUR 10 533	EUR 10 919
	Jährliche Durchschnittsrendite	5.3%	3.0%

Diese Tabelle zeigt, was Sie über die nächsten 3 Jahre unter Zugrundelegung verschiedener Szenarien bei einer Anlage von 10.000,00 EUR zurückbekommen könnten. Die angegebenen Szenarien zeigen, wie sich Ihre Anlage entwickeln könnte. Sie können diese mit den Szenarien für andere Produkte vergleichen. Bei den dargestellten Szenarien handelt es sich um eine Schätzung der künftigen Wertentwicklung auf der Grundlage der in der Vergangenheit festgestellten Wertschwankungen dieser Anlage, die auch Daten von Benchmarks/Proxies aus den letzten zehn Jahren enthalten können. Die Märkte könnten sich in Zukunft ganz anders entwickeln. Was Sie bekommen, hängt von der Entwicklung des Marktes und davon ab, wie lange Sie das Produkt behalten. Das Stress-Szenario zeigt, was Sie unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen bekommen könnten, und es berücksichtigt die Situation nicht, dass wir Sie nicht bezahlen können. Die angegebenen Zahlen enthalten alle Kosten des Produkts selbst, sie enthalten jedoch eventuell nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Broker, Finanzberater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen. Unberücksichtigt ist auch Ihre persönliche steuerliche Situation, die sich ebenfalls auf den am Ende erzielten Betrag auswirken kann.

3. Was geschieht, wenn Verwaltungsgesellschaft nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Die Vermögenswerte des Fonds sind rechtlich von den Vermögenswerten des Herstellers getrennt. Wenn der Fonds nicht in der Lage ist, Zahlungen zu leisten (insbesondere aufgrund von Insolvenz), können Sie einen finanziellen Verlust erleiden. Die Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin, wurde zur Verwahrstelle des Fonds (die „Verwahrstelle“) ernannt. Dem Anleger kann durch den Ausfall der Verwahrstelle, die gemäß der OGAW-Richtlinie 2009/65/EG als Verwahrstelle des Fonds fungiert, ein finanzieller Verlust entstehen. Es besteht ein potenzielles Haftungsrisiko für die Verwahrstelle, wenn die Vermögenswerte des Fonds verloren gehen. Die Verwahrstelle haftet, wenn sie fahrlässig oder vorsätzlich ihre Verpflichtungen gemäß der OGAW-Richtlinie 2009/65/EG nicht ordnungsgemäß erfüllt. Verluste sind nicht durch ein Anlegerentschädigungs- oder Garantiesystem gedeckt.

4. Welche Kosten entstehen?

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder die Sie dazu berät, berechnet Ihnen eventuell weitere Kosten. Wenn dies der Fall ist, wird diese Personen Ihnen Angaben zu diesen Kosten machen und Ihnen die Auswirkungen zeigen, die diese Kosten im Laufe der Zeit auf Ihre Anlage haben.

Die Renditeminderung (Reduction in Yield, RIY) zeigt die Auswirkungen der von Ihnen gezahlten Gesamtkosten auf die Anlagerendite, die Sie eventuell bekommen. Die Gesamtkosten berücksichtigen einmalige, laufende und Nebenkosten.

Kosten im Zeitverlauf

	Gesamtkosten	Auswirkung auf die Rendite (RIY) pro Jahr
Wenn Sie nach 1 Jahr einlösen	EUR 300	3.0%
Wenn Sie am Ende der empfohlenen Haltedauer einlösen	EUR 300	1.0%

Die in dieser Tabelle aufgeführten Kosten stellen den erwarteten Betrag der Produktkosten dar, die sich auf Ihre Rendite auswirken würden, wenn man davon ausgeht, dass:

- (i) Sie im ersten Jahr den von Ihnen investierten Betrag zurückerhalten (d. h. 0 % jährliche Rendite)
- (ii) für die verbleibenden Halteperioden entwickelt sich das Produkt wie im mittleren Szenario beschrieben
- (iii) Sie haben 10.000 EUR investiert.

*Dies veranschaulicht das Ausmaß, in dem die Kosten Ihre jährliche Rendite während der Haltedauer verringern. Sie zeigt zum Beispiel, dass bei einem Ausstieg am Ende der empfohlenen Haltedauer eine durchschnittliche jährliche Rendite von 2.4% vor Abzug der Kosten und 1.4% nach Abzug der Kosten zu erwarten ist.

Zusammensetzung der Kosten

Aus der nachfolgenden Tabelle geht Folgendes hervor (i) wie sich die verschiedenen Arten von Kosten jedes Jahr auf die Rendite auswirken, die Sie am Ende der empfohlenen Haltedauer erhalten könnten; welche Bedeutung die verschiedenen Kostenkategorien beinhalten.

			Wenn Sie nach 1 Jahr einlösen
Einmalige Kosten	Einstiegskosten	Bis zu 3.00% des Betrages, den Sie bei der Investition einzahlen.	EUR 300
	Ausstiegskosten	Bis zu 0.00% des Betrages, den Sie beim Ausstieg aus der Anlage erhalten.	EUR 0
Laufende Kosten	Portfolio-Transaktionskosten	0% des Wertes Ihrer Investition pro Jahr.	EUR 0
	Sonstige laufende Kosten	0.35% des Wertes Ihrer Investition pro Jahr.	EUR 35
Zusätzliche Kosten	Erfolgsgebühr	Für dieses Produkt wird keine Performancegebühr erhoben.	---
	Carried interest	Für dieses Produkt wird keine Performancegebühr erhoben.	---

5. Wie lange sollte ich die Anlage halten, und kann ich vorzeitig Geld entnehmen?

Empfohlene Haltedauer: 3 Jahre

Für dieses Produkt besteht keine empfohlene Mindesthaltungsdauer, es ist jedoch für langfristige Anlagen konzipiert. Jede Anlage sollte vor dem Hintergrund Ihrer spezifischen Anlagebedürfnisse und Ihrer Risikobereitschaft betrachtet werden. Ossiam prüft die Eignung oder Angemessenheit dieser Anlage für Ihre persönlichen Umstände nicht. Falls Sie Fragen zur Eignung dieses Produkts für Ihre Anforderungen haben, sollten Sie entsprechende professionelle Beratung in Anspruch nehmen. Sie können Ihre ETF-Wertpapiere täglich auf dem Sekundärmarkt über einen Intermediär an der/den Börse(n), an der/denen die ETF-Wertpapiere gehandelt werden, kaufen oder verkaufen.

6. Wie kann ich mich beschweren?

Sie können eine E-Mail an info@ossiam.com oder per Post an die folgende Adresse senden: Ossiam, 36 rue Brunel, 75017, Paris, Frankreich. Die vollständige Richtlinie zur Behandlung von Beschwerden finden Sie unter www.ossiam.com.

7. Sonstige zweckdienliche Angaben

Vorvertragliche ESG-Informationen: Der Fonds bewirbt keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale und hat keine nachhaltigen Investitionen zum Ziel (SFDR Artikel 6)

Informationen zu Steuern und Eignung: Wenden Sie sich an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle.

Wertentwicklung in der Vergangenheit: Gehen Sie auf www.ossiam.com. Bitte beachten Sie, dass die frühere Wertentwicklung nicht auf zukünftige Ergebnisse schließen lässt.

Sonstige Angaben: Der aktuelle Verkaufsprospekt, die Jahres-/Halbjahresberichte, der Nettoinventarwert und weitere Produktinformationen sind kostenlos unter www.ossiam.com erhältlich.

