

BASISINFORMATIONENBLATT

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.

OSSIAM US STEEPENER - UCITS ETF 1C (USD)

Name des Fondsinitiators : Ossiam

ISIN : LU1965301184

Kontakt: www.ossiam.com

Rufen Sie +33 1 84 79 42 70 an, um weitere Informationen zu erhalten.

Die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) ist für die Kontrolle von Ossiam in Bezug auf dieses Dokument mit wesentlichen Informationen zuständig.

Ossiam ist in Frankreich unter der Nummer GP-10000016 zugelassen und wird von der AMF reguliert.

Produktionsdatum : 01/11/2025

1. Um welche Art von Produkt handelt es sich ?

Art : Der Fonds ist ein passiv verwalteter Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) ETF nach Luxemburger Recht in Form eines Teilfonds der Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV).

Verfall : Dieses Produkt hat kein bestimmtes Verfallsdatum. Dieses Produkt kann jedoch aufgelöst oder zusammengelegt werden; in diesem Fall werden Sie auf jede geeignete, von den Vorschriften vorgesehene Weise darüber informiert.

Ziele : Anlageziel des OSSIAM US Steepener (der "Fonds") ist es, vor Abzug der Gebühren und Aufwendungen des Fonds die Wertentwicklung des Solactive US Treasury Yield Curve Steepener 2-5 gegenüber dem Index 10-30 nachzubilden. Der Fonds wird passiv verwaltet. Der Solactive US Treasury Yield Curve Steepener 2-5 vs 10-30 Index (der "Index") ist ein in USD ausgedrückter gehobelter Index, der von Solactive (der "Indexanbieter") erstellt und von der Solactive AG berechnet und veröffentlicht wird. Eine detaillierte Beschreibung des Indexes finden Sie im Abschnitt "Beschreibung des Indexes" und "Zusätzliche Informationen zur Hebelpolitik". Der Index ist in Futures auf US-Treasury-Anleihen investiert und soll von einer Erhöhung der USD-Zinskurve, gemessen als Differenz zwischen langfristigen und kurzfristigen Zinssätzen, mit dem Ziel der Beibehaltung der Duration profitieren. Der Index wird dieses Ziel durch den Kauf kurzfristiger US-Treasury-Futures und den Verkauf langfristiger US-Treasury-Futures erreichen. Der erwartete Tracking Error bei normalen Bedingungen beträgt 1,00% über einen Zeitraum von einem Jahr. Die Indexzusammensetzung wird vierteljährlich neu konstituiert. Eine detaillierte Beschreibung des Indexes finden Sie im Abschnitt "Beschreibung des Indexes" im jeweiligen Fondsanhang des Verkaufsprospekts.

Anlagepolitik : Um sein Anlageziel zu erreichen, investiert der Fonds hauptsächlich durch physische Replikation in Anleihen und ganz oder teilweise in Futures-Kontrakte des Indexes. Der Fonds kann im Interesse seiner Anteilinhaber auch Swaps einsetzen, um die Wertentwicklung des Indexes durch synthetische Replikation nachzubilden. Zu diesem Zweck investiert der Fonds über Swap-Kontrakte mit einem Swap-Kontrahenten in ein Portfolio von Vermögenswerten, deren Wertentwicklung gegen die des Indexes, eines zugehörigen Index oder eines Portfolios seiner Bestandteile getauscht wird. Diese Methode beinhaltet ein Gegenparteirisiko, wie im nachfolgenden Abschnitt Risiken und Renditen beschrieben. Infolgedessen steigt (oder fällt) der Nettoinventarwert des Fonds im Einklang mit den Indexänderungen. Die Swap-Gegenpartei muss ein erstklassiges Finanzinstitut sein, das auf diese Art von Geschäften spezialisiert ist. Der Fonds kann mit Gegenparteien, die die oben genannten Merkmale aufweisen, mehrere Swap-Kontrakte abschließen. Im Falle einer synthetischen Replikation kann zwischen dem/den Swap-Kontrahenten und dem Index-Anbieter eine Indexlizenzvereinbarung bestehen, so dass die Lizenzgebühren in den Swapkosten enthalten sein können. Der Fonds kann im besten Interesse seiner Anteilinhaber beschließen, ganz oder teilweise von einer der oben beschriebenen Replikationsmethoden auf eine andere umzusteigen. Der Fonds kann im besten Interesse seiner Anteilinhaber die Wertentwicklung des Indexes auch durch eine Kombination der oben beschriebenen physikalischen und synthetischen Replikationsmethoden nachbilden. Bei allen vorgenannten Replikationsstrategien wird der Fonds jederzeit zu mindestens 75% in auf US-Dollar lautende Anleihen investiert, die entweder von Unternehmen oder von der US-Regierung ausgegeben werden. Unternehmensanleihen haben eine Restlaufzeit von weniger als 3 Jahren und ein Mindestrating von BBB- von Standard & Poor's oder Baa3 von Moody's (Investment Grade-Äquivalent). Der Fonds ist auf der Ebene des Indexes einem Hebeleffekt ausgesetzt, der Hebeleffekte in seine Methodik einbezieht. Der Commitment-Ansatz wird verwendet, um das Gesamtrisiko des Fonds zu berechnen (wie nachstehend im Abschnitt Risiko und Rendite beschrieben). Der Fonds zahlt keine Gebühren im Zusammenhang mit Hebeleffekten. Die Wertentwicklung des Fonds wird mittel- bis langfristig relativ nahe am Bewertungsmultiplikator des Indexes bleiben.

Zuweisung der ausschüttungsfähigen Beträge : Kapitalisierung.

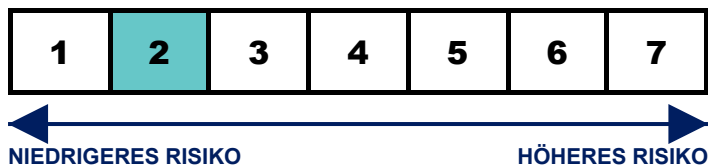
Kleinanleger-Zielgruppe : Anleger, die die Risiken des Fonds verstehen und eine mittel- bis langfristige Anlage planen (mindestens 3 Jahre). Der Fonds richtet sich an Anleger, die: (i) eine wachstumsorientierte Anlage mit einem nachhaltigen Anlageansatz suchen, (ii) sind an einem Engagement in der Versteigerung der US-Renditekurve entweder als Kerninvestition oder zu Diversifikationszwecken interessiert; (iii) ein hohes Risikoprofil aufweisen und erheblichen Verlusten standhalten können. Die Anteile dieses Fonds wurden nicht nach dem "US Securities Act of 1933" registriert und dürfen weder direkt noch indirekt für Rechnung oder zugunsten einer "US-Person" im Sinne der US "Regulation S" und/oder des "Foreign Account Tax Compliance Act" angeboten oder verkauft werden. In Anbetracht der Bestimmungen der EU-Verordnung Nr. 833/2014 und der EU-Verordnung 2022/398 ist die Zeichnung von Anteilen an diesem Fonds jedem russischen oder weißrussischen Staatsangehörigen, jeder natürlichen Person mit Wohnsitz in Russland oder Belarus oder jeder juristischen Person, Organisation oder Einrichtung mit Sitz in Russland oder Belarus mit Ausnahme von Staatsangehörigen eines Mitgliedstaats und natürlichen Personen, die einen vorübergehenden oder dauerhaften Aufenthaltstitel in einem Mitgliedstaat besitzen, untersagt.

Verwahrstelle : State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg.

Zusätzliche Informationen : Die Vorschriften des Fonds sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind auf der Website der Verwaltungsgesellschaft abrufbar und können auf schriftliche Anfrage kostenlos bei info@ossiam.com angefordert werden. Der Nettoinventarwert kann auf der Website der Verwaltungsgesellschaft eingesehen werden. www.ossiam.com

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

Risikoindikator



Der Risikoindikator geht davon aus, dass Sie dieses Produkt 3 Jahre lang halten. Das reale Risiko kann sehr unterschiedlich sein, wenn Sie sich entscheiden, vor Ablauf zu beenden, und Sie können weniger im Gegenzug erhalten. Der Risikoindikator ermöglicht es Ihnen, das Risikoniveau dieses Produkts im Vergleich zu anderen zu beurteilen. Es gibt die Wahrscheinlichkeit an, dass dieses Produkt im Falle von Marktbewegungen oder unserer Zahlungsunfähigkeit Verluste verursacht.

Wir haben den Fonds in die Risikoklasse 2 eingestuft, die eine niedrige Risikoklasse darstellt. Mit anderen Worten: Die potenziellen Verluste im Zusammenhang mit der zukünftigen Wertentwicklung des Produkts sind gering, und selbst bei einer Verschlechterung der Marktbedingungen ist es sehr unwahrscheinlich, dass unsere Zahlungsfähigkeit beeinträchtigt wird. Das folgende Risiko, das in dem Indikator nicht berücksichtigt wird, kann sich negativ auf den Nettoinventarwert des Fonds auswirken: Das Marktliquiditätsrisiko könnte die Schwankungen der Wertentwicklung des Produkts verstärken.

Vorsicht vor Währungsrisiken. Wenn die an Sie gezahlten Beträge in einer anderen Währung sind, hängt Ihr endgültiger Gewinn vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen ab. Dieses Risiko wird im obigen Indikator nicht berücksichtigt. Neben den im Risikoindikator enthaltenen Risiken können auch andere Risiken die Wertentwicklung des Fonds beeinflussen. Siehe Prospekt des Fonds. Da dieses Produkt keinen Schutz vor den Launen des Marktes bietet, könnten Sie Ihre Anlage ganz oder teilweise verlieren.

Performance Scenarios

In den angegebenen Zahlen sind alle Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch nicht unbedingt alle Gebühren, die Ihrem Berater oder Ihrer Vertriebsstelle geschuldet werden. Diese Zahlen berücksichtigen nicht Ihre persönliche Steuersituation, was sich auch auf die Beträge auswirken kann, die Sie erhalten. Was Sie von diesem Produkt erhalten, hängt von der zukünftigen Marktentwicklung ab. Die künftigen Markttrends sind zufällig und können nicht genau vorhergesagt werden. Die dargestellten ungünstigen, moderaten und günstigen Szenarien sind Beispiele für die beste und schlechteste Wertentwicklung sowie die durchschnittliche Wertentwicklung des Produkts in den letzten 10 Jahren. Die Märkte können sich in der Zukunft sehr unterschiedlich entwickeln. Das Stressszenario zeigt, was man in extremen Marktsituationen erreichen kann.

		1 Jahre	3 Jahre (Empfohlene Haltedauer)
Stressszenario	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten	USD 8 599	USD 8 680
	Jährliche Durchschnittsrendite	-14,01%	-4,61%
Pessimistisches Szenario	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten	USD 8 916	USD 8 979
	Jährliche Durchschnittsrendite	-10,84%	-3,53%
Mittleres Szenario	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten	USD 10 665	USD 9 592
	Jährliche Durchschnittsrendite	6,65%	-1,38%
Optimistisches Szenario	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten	USD 10 807	USD 10 988
	Jährliche Durchschnittsrendite	8,07%	3,19%

Pessimistisches Szenario:
Diese Art von Szenario trat bei einer Investition zwischen 31/03/2021 und 28/03/2024

Mittleres Szenario:
Diese Art von Szenario trat bei einer Investition zwischen 30/04/2019 und 29/04/2022

Optimistisches Szenario:
Diese Art von Szenario trat bei einer Investition zwischen 30/09/2022 und 30/09/2025

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

Das Produkt ist ein Miteigentum an Finanzinstrumenten und Einlagen, die von der Portfolioverwaltungsgesellschaft getrennt sind. Im Falle eines Ausfalls wird das von der Verwahrstelle gehaltene Vermögen des Produkts nicht beeinträchtigt. Im Falle des Ausfalls der Verwahrstelle wird das Risiko eines finanziellen Verlustes des Produkts durch die rechtliche Trennung der Vermögenswerte der Verwahrstelle von denen des Produkts gemindert.

4. Welche Kosten entstehen ?

Die Person, die Sie über diesen Fonds verkauft oder berät, kann Sie auffordern, zusätzliche Kosten zu zahlen. Wenn dies der Fall ist, werden sie Sie über diese Kosten informieren und Ihnen zeigen, wie sie Ihre Anlage beeinflussen. Die Ertragsreduktion (RIY, Reduction In Yield) zeigt die Auswirkungen der Gesamtkosten, die Sie auf die Rendite Ihrer Anlage zahlen. Die Gesamtkosten berücksichtigen einmalige, gewöhnliche und zusätzliche Kosten.

Kosten im Zeitverlauf

	Gesamtkosten	Auswirkung auf die Rendite (RIY) pro Jahr*
Wenn Sie nach 1 Jahr einlösen	USD 49	0,49%
Wenn Sie am Ende der empfohlenen Haltedauer einlösen	USD 133	0,46%

Die Tabellen zeigen die von Ihrer Anlage abgezogenen Beträge zur Deckung der verschiedenen Kostenarten. Diese Beträge hängen vom Anlagebetrag, dem Zeitraum, in dem Sie das Produkt halten, und der Wertentwicklung des Produkts ab. Die hier dargestellten Beträge sind Beispiele, die auf einem beispielhaften Anlagebetrag und unterschiedlichen möglichen Anlageperioden basieren. Wir haben angenommen:

- Im ersten Jahr erhalten Sie den investierten Betrag zurück (0% jährliche Rendite). Dass sich das Produkt für die verbleibenden Haltungszeiträume wie im moderaten Szenario angegeben entwickelt.
- 10.000 USD investiert

*Dies zeigt, inwieweit die Kosten Ihre jährliche Rendite während der Haltedauer schmälern. Zum Beispiel zeigt es, dass wenn Sie am Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigen, Ihre durchschnittliche Jahresrendite -0.92% vor Abzug der Kosten und -1.38% nach Abzug dieser Kosten betragen könnte.

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 0.00% des Betrags, den Sie bei der Investition zahlen.	USD 0
	Ausstiegskosten*	Bis zu 0.00% des Betrags, den Sie beim Ausstieg aus der Investition zahlen.	USD 0
Laufende Kosten	Portfolio-Transaktionskosten	0.02% des Wertes Ihrer Anlage pro Jahr.	USD 2
	Sonstige laufende Kosten	0.30% des Wertes Ihrer Anlage pro Jahr.	USD 30
Zusätzliche Kosten	Erfolgsgebühr	Für dieses Produkt wird keine Performancegebühr erhoben.	---
	Carried interests	Für dieses Produkt wird keine carried interest erhoben.	---

* Sekundärmarkt: Da es sich bei dem Fonds um einen börsengehandelten Fonds handelt, können Anleger, die keine zugelassenen Teilnehmer sind, im Allgemeinen nur auf dem Sekundärmarkt Anteile kaufen oder verkaufen. Dementsprechend werden die Anleger Maklergebühren und/oder Transaktionskosten im Zusammenhang mit ihren Geschäften an der/den Börse(n) zahlen. Diese Maklergebühren und/oder Transaktionskosten werden weder vom Fonds noch von der Verwaltungsgesellschaft erhoben noch an diese gezahlt, sondern an den eigenen Vermittler des Anlegers. Darüber hinaus können die Anleger auch die Kosten für die „Geld-Brief-Spanne“ tragen, d.h. die Differenz zwischen den Preisen, zu denen Anteile gekauft und verkauft werden können.

Primärmarkt: Zugelassene Teilnehmer, die direkt mit dem Fonds handeln, zahlen die entsprechenden Transaktionskosten für den Primärmarkt.

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

Empfohlene Haltedauer: 3 Jahre.

Dieses Produkt hat keinen vorgeschriebenen Mindestbestand Empfohlene (RHP, Recommended Holding Period), ist aber für eine mittelfristige Investition ausgelegt. Jede Anlage sollte je nach Ihren spezifischen Anlagebedürfnissen und Ihrem Risikoappetit berücksichtigt werden. OSSIAM berücksichtigt nicht die Eignung oder Angemessenheit dieser Investition für Ihre persönliche Situation. Wenn Sie Zweifel an der Eignung dieses Produkts für Ihre Bedürfnisse haben, sollten Sie sich professionell beraten lassen. Sie können Ihre ETF-Wertpapiere täglich am Sekundärmarkt über einen Vermittler an der/den Börse(n) kaufen oder verkaufen, an der/denen die ETF-Wertpapiere gehandelt werden.

Bearbeitung von Anträgen:

Zeichnungs- und Rücknahmeanträge gehen bis spätestens 4:00 Uhr (Luxemburger Zeit) ein. UCITS ETF 1C (USD) Anteile sind an einer oder mehreren Börs(en) notiert. Anleger können ihre Anteile entweder über ihren üblichen broker, an jedem Handelstag der betreffenden Börs(en), der auch ein Handelstag ist, oder über eine Vertriebsplattform des Fonds kaufen und verkaufen. Bitte kontaktieren Sie Ihren broker für weitere Informationen. Für weitere Informationen lesen Sie bitte den Abschnitt "Zeichnung, Übertragung, Umtausch und Rücknahme von Anteilen" und den Abschnitt "Praktische Informationen" im Anhang des Fonds im Prospekt.

6. Wie kann ich mich beschweren ?

Sie können eine Beschwerde über das Produkt oder das Verhalten von (i) die Verwaltungsgesellschaft (ii) eine Person, die über das Produkt berät, oder (iii) eine Person, die das Produkt verkauft, indem sie gegebenenfalls eine E-Mail oder einen Brief an die folgenden Personen schickt :

- Wenn Ihre Beschwerde das Produkt selbst oder das Verhalten der Verwaltungsgesellschaft betrifft, wenden Sie sich bitte an die Verwaltungsgesellschaft, per Post, in der 36 rue Brunel 75017 Paris (Frankreich) zu Händen von OSSIAM - Compliance oder per E-Mail an info@ossiam.com. Ein Verfahren zur Behandlung von Beschwerden kann auf der Website der Verwaltungsgesellschaft www.ossiam.com abgerufen werden
- Wenn Ihre Beschwerde eine Person betrifft, die das Produkt berät oder anbietet, wenden Sie sich bitte direkt an diese Person.

7. Sonstige zweckdienliche Angaben

SFDR Kategorie : Artikel 8

Lebensversicherung : Wenn dieses Produkt als fondsgebundener Vermittler in einem Lebensversicherungs- oder Kapitalisierungsvertrag verwendet wird, sind zusätzliche Informationen zu diesem Vertrag, wie die Kosten des Vertrags, die nicht in den in diesem Dokument angegebenen Kosten enthalten sind, der Kontakt im Schadensfall und was im Falle eines Ausfalls durch das Versicherungsunternehmen passiert, in den wesentlichen Informationen für diesen Vertrag aufgeführt, die von Ihrem Versicherer oder Makler oder einem anderen Versicherungsvermittler in Übereinstimmung mit seiner gesetzlichen Verpflichtung zur Verfügung gestellt werden müssen.