

Il presente documento contiene le informazioni chiave di cui tutti gli investitori devono disporre in relazione a questo Fondo. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni contenute nel presente documento, richieste dalla legge, hanno lo scopo di aiutare l'investitore a comprendere la natura di questo Fondo e i rischi ad esso connessi. Si raccomanda di prenderne visione, in modo da operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire.

## OSSIAM STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR (UCITS ETF 1C (EUR) ISIN: LU0599613147), un comparto di OSSIAM LUX SICAV

Società di gestione: Ossiam, parte del gruppo di società Natixis

### Obiettivi e politica d'investimento

#### Obiettivo d'investimento

L'obiettivo di investimento del fondo OSSIAM STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR (il "Fondo") consiste nel replicare, al netto di commissioni e spese, la performance dell'indice STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index Net Return EUR (l'"Indice") al prezzo di chiusura. Il Fondo è gestito passivamente.

Lo STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index Net Return EUR (l'"Indice", ISIN: CH0124001543) è un indice a rendimento assoluto (con reinvestimento dei dividendi netti) espresso in euro e calcolato e pubblicato da STOXX (il "Fornitore dell'Indice").

L'indice STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index è la versione "equally-weighted" (cioè caratterizzata dall'eguaglianza dei fattori di ponderazione) del noto indice di mercato STOXX® EUROPE 600 Index (l'"Indice di Base") che segue la performance delle 600 più importanti società dei principali settori di 18 Paesi europei. I componenti dell'Indice sono gli stessi dello STOXX® EUROPE 600 Index ponderato per capitalizzazione di mercato, tuttavia a ciascuna società dell'Indice è assegnato lo stesso peso (di norma lo 0,1667%), ribilanciato con frequenza trimestrale. Di conseguenza, le esposizioni settoriali dell'Indice non coincidono con quelle dell'Indice di base.

Per la descrizione dettagliata dell'Indice si rimanda alla sezione "Descrizione dell'Indice" nell'Allegato del Fondo nel Prospetto.

#### Politica d'investimento

Per conseguire il proprio obiettivo di investimento, il Fondo utilizza prevalentemente swap su indici al fine di ottenere esposizione all'Indice attraverso una replicazione sintetica. In questo caso il Fondo investe in un portafoglio di attivi il cui rendimento viene scambiato con il rendimento prodotto dall'Indice mediante un contratto swap stipulato con una controparte. Questo metodo implica un rischio di controparte secondo quanto descritto nella sezione Profilo di rischio e rendimento qui di seguito. Il valore patrimoniale netto del Fondo per azione è pertanto destinato a salire (o scendere) a seconda dell'andamento dell'Indice.

La controparte del contratto swap è sempre un istituto finanziario di prim'ordine specializzato in questo tipo di operazioni.

Il Fondo può altresì stipulare più contratti swap con più controparti, aventi le caratteristiche sopra descritte.

In alternativa, il Fondo può investire - del tutto o in parte - nei titoli azionari che compongono l'Indice.

Il Fondo può inoltre, sempreché ciò sia nell'interesse dei suoi Azionisti, decidere di passare interamente o in parte dall'una all'altra delle strategie sopra descritte (replicazione sintetica o replicazione fisica).

Con entrambe le strategie di replicazione, il Fondo sarà costantemente investito per un minimo del 75% in titoli azionari o diritti emessi da società aventi sede legale nell'Area economica europea, ad eccezione del Liechtenstein.

In aggiunta e a titolo accessorio, il Fondo può impiegare altri derivati a fini di copertura e investimento e sottoscrivere operazioni che prevedono la concessione e l'acquisizione di titoli in prestito, nonché contratti di riacquisto, secondo quanto descritto nella successiva sezione "Uso di derivati, investimenti speciali e tecniche di copertura" del Prospetto.

La valuta di riferimento del Fondo è l'euro.

Le Azioni UCITS ETF 1C(EUR) sono quotate in una o più borse e gli investitori possono acquistare o vendere le Azioni attraverso il proprio consueto agente di borsa in qualsiasi giorno di negoziazione della borsa in questione che sia anche giorno di negoziazione in Lussemburgo oppure tramite una piattaforma di fondi. Rivolgersi al proprio agente di borsa per ulteriori informazioni. La Classe di azioni 1C(EUR) è a capitalizzazione degli utili, quindi i redditi derivanti dal Fondo vengono reinvestiti. Per ulteriori informazioni si rimanda alla sezione "Sottoscrizione, trasferimento, conversione e rimborso delle azioni" e alla sezione "Informazioni pratiche" del relativo Allegato del Fondo nel Prospetto.

Raccomandazione: questo Fondo potrebbe non essere indicato per gli investitori che prevedono di ritirare il proprio capitale entro 5 anni.

### Profilo di rischio e di rendimento

Rischio più basso

Rischio più alto



Rendimento potenzialmente più basso

Rendimento potenzialmente più alto

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Il Fondo è classificato con un livello di rischio 6 sulla scala di riferimento di rischio e rendimento, basata su dati storici. A causa dell'esposizione ai mercati azionari, il Fondo può essere soggetto a una forte volatilità, come indicato dalla classificazione della scala precedente.

I risultati passati non sono necessariamente indicativi di quelli futuri. La categoria di rischio illustrata non è garantita e può variare nel tempo. Non vi sono garanzie di protezione del capitale o sul valore del Fondo. La categoria più bassa non indica l'assenza totale di rischio.

#### Considerazioni particolari sul rischio

**Rischio legato all'Indice:** Il valore delle Azioni del Fondo è collegato all'Indice, il cui valore può salire o scendere. Di

conseguenza, si fa presente agli investitori che il valore del loro investimento può essere soggetto a variazioni positive o negative e che non è possibile garantire che la metodologia dell'Indice sottostante sarà in grado di produrre rendimenti superiori a quelli di altre strategie di investimento comparabili, né che verrà loro rimborsato il capitale inizialmente investito.

#### Rischio per derivati e di controparte:

Come conseguenza delle operazioni associate a swap, il Fondo è soggetto a potenziali rischi in termini di controparte ed emittenti. Nel caso di insolvenza della controparte o dell'emittente o mancato adempimento dei relativi obblighi, il Fondo potrebbe registrare delle perdite.

Il valore delle operazioni associate a swap può variare in base a vari fattori quali (a solo titolo di esempio) il livello dell'Indice, il livello dei tassi di interesse e la liquidità del mercato azionario.

Per ulteriori dettagli sui rischi, si rimanda alla sezione "Fattori di rischio generici" del Prospetto completo.

## Spese

Le spese corrisposte dall'investitore sono usate per coprire i costi di gestione del Fondo, compresi i costi legati alla sua commercializzazione e distribuzione, e riducono la crescita potenziale dell'investimento.

### Spese per Classe di azioni - Classe di azioni UCITS ETF 1C (EUR)

#### Spese una tantum prelevate prima o dopo l'investimento

<b>Spesa di sottoscrizione</b>	Commissione di vendita massima 3,00% Commissione di replicazione massima per le sottoscrizioni 1,00%
<b>Spesa di rimborso</b>	Commissione di rimborso massima 3,00% Commissione di replicazione massima per i rimborsi 1,00 %

Questo è il massimo importo deducibile dai fondi del cliente prima del loro investimento o dal ricavato versatogli alla vendita dell'investimento.

#### Spese prelevate dal Fondo in un anno

<b>Spese correnti</b>	0,35% annuo
-----------------------	-------------

#### Spese prelevate dal Fondo a determinate condizioni specifiche

<b>Commissione di performance</b>	Nessuna
-----------------------------------	---------

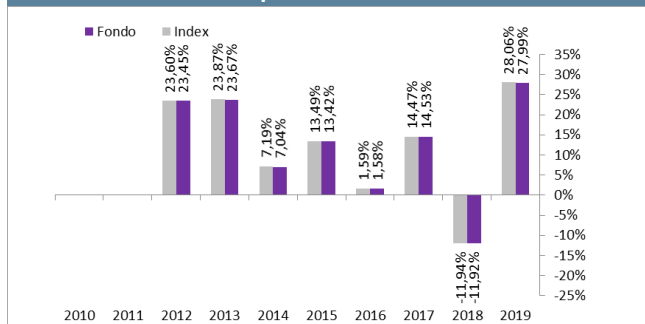
Le **spese di sottoscrizione** e **rimborso** indicate corrispondono alla percentuale massima. In alcuni casi è possibile che l'investitore debba corrispondere un importo inferiore; per ulteriori informazioni rivolgersi al proprio consulente finanziario.

\* Una commissione supplementare non superiore al 2,00% può essere applicata agli investitori che effettuino operazioni eccessivamente frequenti o di market timing.

L'importo delle **spese correnti** qui riportato si basa sulle spese dell'anno precedente, conclusosi a dicembre 2019 e può variare da un anno all'altro. Tali spese escludono le spese per le operazioni di portafoglio a eccezione delle commissioni di sottoscrizione/rimborso versate dalla SICAV per l'acquisto o la vendita di quote in un altro investimento collettivo.

Per ulteriori informazioni sulle spese si rimanda ai capitoli "Oneri e spese" e "Sottoscrizione, trasferimento, conversione e rimborso di azioni" del prospetto del Fondo, disponibile sul sito web [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com).

## Risultati ottenuti nel passato



La performance passata non è necessariamente indicativa dei risultati futuri.

Questo grafico a barre mostra la performance della Classe di azioni UCITS ETF 1C (EUR) nella relativa valuta di quotazione, al netto delle spese correnti ed escludendo le spese di sottoscrizione o rimborso.

Data di costituzione del Fondo: 16 maggio 2011

Data di creazione della Classe di azioni: 16 maggio 2011

## Informazioni pratiche

### Depositario del Fondo e Agente amministrativo:

State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch  
49, avenue J.F. Kennedy  
L-1855 Lussemburgo

**Termine di negoziazione:** 15.30 (ora di Lussemburgo)

Il valore patrimoniale netto indicativo del Fondo può essere consultato sul sito [www.euronext.com](http://www.euronext.com). Le informazioni relative al portafoglio del Fondo vengono comunicate nei bilanci annuali e semestrali del Fondo.

Per ottenere gratuitamente informazioni aggiuntive sulla SICAV e sul Fondo (compresa la versione inglese del Prospetto completo, delle relazioni e dei bilanci dell'intera SICAV), sulla procedura di scambio di Azioni da un comparto a un altro, rivolgersi alla sede legale della Società di Gestione o del Depositario del Fondo/Agente Amministrativo. Consultare il sito [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com) o rivolgersi alla sede legale della Società di gestione o dell'Agente Amministrativo per conoscere il prezzo ad Azione del Fondo.

Una descrizione della politica sulle remunerazioni aggiornata della Società di Gestione, con la descrizione delle modalità di calcolo delle remunerazioni e dei benefit, è disponibile alla pagina [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com). Si può richiederne una copia cartacea gratuita.

Attività e passività di ciascun comparto sono suddivise; di conseguenza i diritti degli investitori e dei creditori su un dato comparto si limitano alle attività di tale comparto, salvo se diversamente indicato nei documenti costitutivi della SICAV.

Questo Fondo può essere soggetto a tassazione specifica in Lussemburgo. In base al paese in cui si risiede, ciò potrebbe avere conseguenze sul proprio investimento. Il Fondo è ammesso al piano di risparmio francese chiamato "PEA" e riservato agli investitori francesi. Per ulteriori dettagli, rivolgersi a un consulente. Il Fondo si classifica come "fondo azionario ai sensi della Legge tedesca sugli investimenti", come specificato nella sezione "Imposizione fiscale" del Prospetto informativo.

Classe di azioni	ISIN	Tipo di investitori	Valuta	Requisiti minimi di sottoscrizione	Requisiti minimi di rimborso	Politica dei dividendi
UCITS ETF 1C(EUR)	LU0599613147	Tutti gli investitori*	Euro	€2.000.000	€2.000.000	Capitalizzazione

\*Sottoscrizioni nel mercato primario riservate ai partecipanti autorizzati e agli investitori approvati.

Ossiam può essere ritenuta responsabile esclusivamente sulla base di dichiarazioni contenute nel presente documento che risultino fuorvianti, inesatte o incoerenti rispetto alle corrispondenti parti del prospetto per il Fondo.

L'indice "STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index Net Return EUR" è la proprietà intellettuale (compresi i marchi registrati) di STOXX Limited, zurighese, Svizzera e/o dei suoi licenziatari, che viene utilizzata su licenza. Il Fondo basato sull'Indice non è in alcun modo sponsorizzato, approvato, venduto o promosso da STOXX e dai suoi licenziatari e nessuno dei licenziatari ha alcuna responsabilità rispetto a tale.

Il Fondo è autorizzato in Lussemburgo e regolamentato dalla Commission de Surveillance du Secteur Financier, autorità di vigilanza locale.

Ossiam è autorizzata in Francia e regolamentata dalla Autorité des Marchés Financiers (AMF), autorità di vigilanza locale.

Le informazioni chiave per gli investitori qui riportate sono aggiornate al 3/07/2020.