Documento de datos fundamentales para el inversor

El presente documento recoge los datos fundamentales sobre este OICVM 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 OICVM 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 BONDS 1-3

Código ISIN: FR0010657387 Participación R (C) EUR / Código ISIN: FR0013381050 Participación R (D) EUR

Sociedad gestora: Natixis Investment Managers International (Grupo BPCE)

OBJETIVOS Y POLÍTICA DE INVERSIÓN

- El objetivo de gestión del FI es doble: tratar de superar la rentabilidad del índice Bloomberg Euro Aggregate Treasury 1-3 year e implementar una estrategia de inversión socialmente responsable (ISR) durante el periodo de inversión mínimo recomendado de más de 2 años.
  Para lograr este doble objetivo, la cartera se construye en dos etapas: la primera consiste en analizar un universo de valores en función de criterios de inversión socialmente responsable (ISR) y la segunda se centra en seleccionar títulos en función de sus características financieras y extrafinancieras.
  La política de inversión se basa en una gestión activa. El gestor es libre de elegir los títulos que componen la cartera, puede invertir o no en títulos que componen el índice de referencia de acuerdo con la estrategia de gestión y las limitaciones de inversión.
- La política de inversión se basa en una gestión activa; el Indicador de referencia se utiliza únicamente con fines de comparación. Por lo tanto, el gestor es libre de elegir los títulos que componen la cartera de acuerdo con la estrategia de gestión y las limitaciones de inversión.
- El FI invierte en títulos emitidos o garantizados por los Estados del Espacio Económico Europeo (EEE) o emitidos por organismos supranacionales, ya sean de tipo fijo o variable, o indexados a la inflación.
  La cartera se construye según una asignación de fuentes de valor añadido: la gestión activa de la sensibilidad y de la curva de tipos, la selección de países y la posible diversificación en títulos indexados a la inflación o de organismos supranacionales, entre otros.
  Además, el universo de inversión inicial incluye criterios extrafinancieros, ya sean ambientales, sociales o de gobernanza (ESG). El FI cumple con las políticas de exclusión aplicadas por el gestor financiero (países incluidos en la lista del GAFI, países sujetos a embargo, etc.). A continuación, se analiza el impacto de estos criterios en el perfil de riesgo de cada emisor. De entre los activos ISR «admisibles», la proporción de emisores sometidos a un análisis ESG debe ser superior al 90 % de manera continua.
  La cartera se construye utilizando un enfoque «best-in-universe». Para las inversiones en bonos verdes de los países, por un lado, y en títulos equivalentes a los bonos soberanos, por otro, se calcula una calificación ESG media para cada universo de inversión extrayendo el 20 % de los emisores con menor calificación. Cada una de las dos calificaciones ESG se pondera por activos sobre el 80 % restante de los emisores de cada universo. La calificación ESG media final para el universo ISR «admisible» se calcula aplicando una ponderación del 50 % a cada uno de los dos subuniversos.

  La clasificación de este OICVM según la AMF es: Obligaciones y otros títulos de crédito denominados en euros.
- El OICVM invierte en títulos denominados en euros emitidos o garantizados por los Estados miembros del EEE de una calidad crediticia muy elevada (HQLA de nivel 1), con el objetivo de respetar la elegibilidad del coeficiente de liquidez LCR. El OICVM no tiene títulos emitidos por emisores privados. En el marco de la gestión, no hay ninguna restricción relacionada con la calificación crediticia mínima de los títulos en los que el OICVM invierte. La sensibilidad de la cartera del fondo varía dentro del intervalo [0-4].
- El OICVM también podrá utilizar instrumentos derivados para cubrir la cartera del riesgo de tipo de interés.
- El OICVM capitaliza sus ingresos mediante las participaciones de capitalización (C) y los distribuye mediante las participaciones de distribución (D).
- Las solicitudes de reembolso de participaciones se reciben todos los días, hasta las 12:30 como máximo, y se ejecutan diariamente.

PERFIL DE RIESGO Y REMUNERACIÓN

Tiene menor riesgo — Tiene mayor riesgo

Habitualmente menor remuneración — Habitualmente mayor remuneración

1	**2**	3	4	5	6	7

La categoría de riesgo refleja la exposición del OICVM a los mercados de renta fija de la zona euro.

- Los datos históricos, que se utilizan para calcular el nivel de riesgo, pueden no constituir una indicación fiable del perfil de riesgo futuro de este OICVM.
- La categoría más baja no significa que la inversión esté libre de riesgo.
- La categoría de riesgo asociada a este OICVM no puede garantizarse y puede variar a lo largo del tiempo.

Riesgos significativos para el OICVM no incluidos en el indicador:

- **Riesgo de crédito:** el riesgo de crédito es el riesgo de deterioro de la calidad de un emisor y/o una emisión, lo que puede suponer un descenso del valor del título. También puede resultar de un incumplimiento de reembolso debido al impago de un emisor incluido en la cartera.
- **Riesgo de contraparte:** el riesgo de contraparte consiste en que una contraparte con la que el OICVM haya contratado fuera de mercado (OTC) no pueda hacer frente a sus obligaciones para con el OICVM.
- **Impacto de las técnicas de gestión y, en particular, de los instrumentos financieros a plazo:** el riesgo relacionado con las técnicas de gestión es el riesgo de amplificación de las pérdidas debido al uso de instrumentos financieros a plazo tales como contratos financieros de mutuo acuerdo y/u operaciones de adquisición y de cesión temporal de títulos.

GASTOS

Los gastos y las comisiones se destinan a sufragar los costes de funcionamiento del OICVM, incluidos los costes de comercialización y distribución de participaciones. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de las inversiones.

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión	
Gastos de entrada	3,00 %
Gastos de salida	Ninguno
Este es el máximo que puede detraerse del capital del inversor antes de proceder a la inversión. En algunos casos, el inversor puede pagar menos. El inversor puede obtener a través de su asesor financiero o su distribuidor el importe efectivo de los gastos de entrada y salida.	
Gastos detraídos del OICVM en el último año	
Gastos corrientes	0,64 %
Gastos detraídos del OICVM en determinadas condiciones específicas	
Comisión de rentabilidad	Ninguno

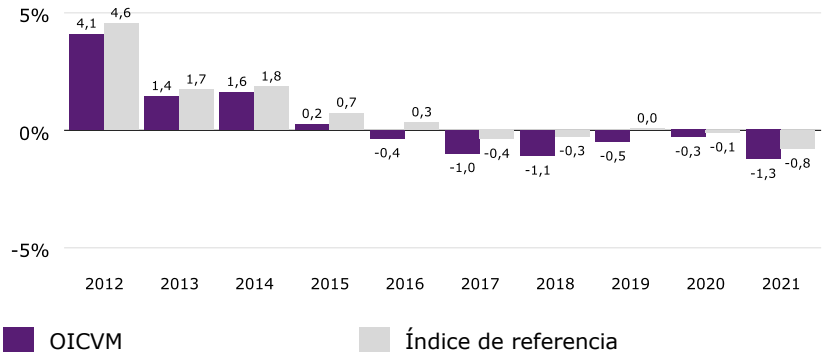
Los gastos corrientes se basan en las cifras del ejercicio precedente cerrado en marzo de 2021. Dicha cifra puede variar de un año a otro.

Los gastos corrientes no incluyen:

- comisiones de rentabilidad.
- los gastos de intermediación, excepto en el caso de gastos de entrada y/o salida soportados por el OICVM con ocasión de la compra o la venta de participaciones de otro organismo de inversión colectiva.

Si desea obtener más información sobre gastos, puede consultar el apartado sobre gastos del folleto de este OICVM en www.im.natixis.com.

RENTABILIDAD HISTÓRICA



A partir del 29 de abril de 2022, el índice de referencia del fondo será el Bloomberg Euro Treasury 1-3y.

- El gráfico de rentabilidades adjunto no es un indicador fiable de las rentabilidades futuras.
- La rentabilidad anual se calcula una vez deducidos los gastos detraídos del OICVM.
- **Año de lanzamiento del OICVM:** 1993.
- **Año de creación de la participación R (C) EUR:** 2008.
- **Año de creación de la participación R (D) EUR:** 2018.
- **Divisa:** euro.
- La rentabilidad de los OICVM no está vinculada a la del índice de referencia. Este último tiene por objeto servir como punto de comparación.

INFORMACIÓN PRÁCTICA

- Depositario: CACEIS Bank.
- El folleto, los informes anuales y los últimos documentos periódicos, así como cualquier otra información práctica del OICVM, se encuentran disponibles en la sociedad gestora previa solicitud por escrito a:
  Natixis Investment Managers International – 43 avenue Pierre Mendès France – 75648 Paris Cedex 13 o a la dirección de correo electrónico siguiente: ClientServicingAM@natixis.com.
- La información relativa a las demás categorías de participaciones está disponible por la misma vía.
- Los detalles de la política de remuneración están disponibles en www.im.natixis.com.
- Fiscalidad: Según cuál sea el régimen fiscal del inversor, las posibles plusvalías y los beneficios relacionados con la tenencia de participaciones pueden estar sujetos a tributación. Se recomienda al inversor que se informe al respecto con su asesor financiero o su distribuidor.
- El valor liquidativo se encuentra disponible en la sociedad gestora, en la dirección de correo postal indicada más arriba, y en su sitio web www.im.natixis.com.
- Natixis Investment Managers International únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto de este OICVM.