Faktablad

CALAMOS
TODAY FOR TOMORROW

Syfte

Detta faktablad ger dig basfakta om denna investeringsprodukt. Det är inte reklammaterial. Informationen krävs enligt lag för att hjälpa dig att förstå produktens egenskaper, risker, kostnader, möjliga vinster och förluster och för att hjälpa dig att jämföra den med andra produkter.

Produkt

Calamos Autocallable Income UCITS

är en delfond tillhörig Waystone ETF ICAV

USD ACC UCITS ETF (IE000DHZXD61)

Calamos Autocallable Income UCITS är auktoriserad i Irland och regleras av Central Bank of Ireland.

Priip-produktutvecklaren och förvaltningsbolaget är Waystone Management Company (IE) Limited som är auktoriserat i Irland och regleras av Central Bank of Ireland. För mer information om denna produkt, vänligen se https://funds.waystone.com/public eller ring +353 (0)16192300.

Stämmer per den: 7 april 2026

Vad innebär produkten?

Typ

Det här är en öppen investeringsfond upprättad som ett irländskt företag för kollektiva investeringar (ICAV) med paraplystruktur.

Mål

Investeringsmål Fondens investeringsmål är att ge investerarna en totalavkastning, baserad på både kapital- och direktavkastning, som återspeglar den totala nettoavkastningen för MerQube US Large-Cap Vol Advantage Autocallable Index (”jämförelseindexet”).

Placeringsinriktning För att uppnå investeringsmålet handlar fondens placeringsinriktning om att ingå totalavkastningsswappar i syfte att uppnå en avkastning som återspeglar utvecklingen för jämförelseindexet och investera i en diversifierad portfölj av penningmarknadsinstrument. Dessa kan omfatta amerikanska statsskuldväxlar, penningmarknadsinstrument (inklusive inlåningscertifikat, företagscertifikat och kortfristiga skuldförbindelser) som emitteras eller garanteras av stater eller offentliga internationella organ globalt, penningmarknadsfonder, insättningar hos kreditinstitut i enlighet med centralbankens UCITS-bestämmelser, inlåningscertifikat och företagscertifikat (de ”likvida tillgångarna”) i syfte att hantera de kassaflöden som krävs enligt totalavkastningsswappen.

Fonden kommer att ingå ofinansierade totalavkastningsswappar med en eller flera motparter (”TRS-motparten”). Varje totalavkastningsswap är ett avtal mellan fonden och TRS-motparten om att byta en ström av kassaflöden mot en annan enligt vad som dokumenteras i huvudswapavtalet, i linje med kraven från International Swaps and Derivatives Association och det som investeringsförvaltaren fastställer.

Fondens syfte med totalavkastningsswappar är att skapa exponering mot avkastningen för jämförelseindexet. I gengäld, kommer fonden att betala TRS-motparten en överenskommen avkastning som återspeglar marknadsräntorna.

Fonden kan också investera upp till 10% av fondens sammanlagda nettoandelsvärde i företag för kollektiva investeringar, inklusive börshandlade fonder (”ETF:er”).

Jämförelseindex Jämförelseindexet är utformat för att spegla utvecklingen för en portfölj av så kallade syntetiska autocallable notes (var och en ett ”autocall-bevis”) (som har MerQube US Large-Cap Vol Advantage Index (”det underliggande referensindexet”) som underliggande referenstillgång).

Ett autocall-bevis är ett instrument som kombinerar egenskaper hos en obligation med ett derivat, och dess utveckling är kopplad till utvecklingen för dess underliggande referenstillgång. Instrumentet gör regelbundna kupongbetalningar (”kupong”) vid förutbestämda observationsdatum (t.ex. månadsvis) och återbetalar kapitalbeloppet på förfallodagen, förutsatt att den relevanta underliggande referenstillgången inte sjunker till under ett specifikt förutbestämt tröskelvärde.

Varje specifikt tröskelvärde som gäller för autocall-beviset benämns ”barriär” och är en förutbestämd resultatnivå som, om den uppnås eller överträffas, kommer att utlösa en särskild rättighet eller åtgärd avseende autocall-beviset. Det finns olika barriärer för olika nyckelfunktioner hos de autocall-bevis som ingår i jämförelseindexet.

Autocall-bevisen i jämförelseindexet följer förutbestämda villkor, inklusive en 5-årig löptid från emissionsdagen, en ettårig period utan förtida inlösen (non call-period) från emissionsdagen och kupongbetalningar varje månad.

Om det underliggande referensindexet på de angivna månatliga observationsdatumen efter non-call-perioden når, eller överstiger, en viss nivå i förhållande till jämförelseindexet (”autocall-barriären”) kommer autocall-beviset automatiskt att förfalla och därmed lösas in eller ”förtidsinlösas”. Kupongen är avsedd att betalas även om det underliggande referensindexet uppvisar en något negativ utveckling, men endast ned till en viss förutbestämd nivå (”kupongbarriären”). Om utvecklingen för det underliggande referensindexet är lägre än kupongbarriären på en observationsdag betalas ingen kupong för den då avslutade observationsperioden. Varje autocall-bevis innehåller en kapitalskyddsfunktion. Det innebär att om det underliggande referensindexet inte har nått eller överskridit autocall-barriären på en månatlig observationsdag före den planerade förfallodagen, kommer en negativ utveckling under autocall-barriären på förfallodagen inte att ha någon negativ inverkan på återbetalningen av det kapitalbelopp som understiger autocall-beviset. Det gäller förutsatt att det underliggande referensindexet inte är under en viss förutbestämd nivå på förfallodagen (”förfallobarriären”).

Jämförelseindexet kommer bestå av 52–260 autocall-bevis. Autocall-bevis är ordnade i en stegvis struktur med förskjutna ingångspunkter och fastställda parametrar. Den stegvisa strukturen syftar till att ge en hög avkastning, samtidigt som den minskar de risker som vanligtvis är förknippade med enskilda autocall-bevis. Några exempel är tajmingrisk vid startpunkten och risk för löptidskoncentration.

Det underliggande referensindexet är utformat för att ge en volatilitetsjusterad exponering mot terminskontrakt för E-Mini S&P 500 (med en målvolatilitet på 35%). E-Mini S&P 500 terminskontrakt är elektroniska terminskontrakt baserade på S&P 500 Index som handlas på Chicago Mercantile Exchange för att ge tillgång till S&P 500 Index utan fysiska innehav i dess beståndsdelar.

Inlösen och handel Dina andelar kommer att vara noterade i US-dollar, fondens basvaluta. Under normala omständigheter får endast auktoriserade deltagare (t.ex. utvalda finansinstitut) handla med andelar (eller intressen i andelar) direkt med fonden. Andra investerare har möjlighet att handla med andelar (eller intressen i andelar) dagligen via en mellanhand på den eller de börser där andelarna handlas. Mer information finns i fondens prospektet.

Utdelningspolicy Fonden är en ackumulerande fond och avser för närvarande inte lämna någon utdelning till investerarna. Fondens intäkter, avkastning och vinst ackumuleras och återinvesteras för investerarnas räkning.

Lanseringsdatum Fonden har ännu inte lanserats.

Fondvaluta Fondens basvaluta är USD.

Separation av tillgångar ICAV:en är en paraplyinvesteringsfond, med åtskilt ansvar mellan delfonderna. Detta innebär att tillgångarna och

skulderna i varje delfond är åtskilda enligt lag. Med andra ord kan en investerare inte kan göra några anspråk på tillgångarna i en delfond som hen inte äger andelar i.

Avsedd privatinvesterare

Denna produkt är avsedd för investerare som planerar att behålla sin investering i minst 5 år och är beredda att ta en risk på en medelhög nivå vad gäller att förlora sitt ursprungliga kapital för att få en högre potentiell avkastning. Den är utformad för att utgöra en del av en investeringsportfölj.

Löptid

Fonden är öppen och har ingen förfallodag. Med förbehåll för likviderings-, upplösnings- och uppsägningsrättigheterna för fondens styrelse enligt vad som anges i fondens prospekt kan fonden inte sägas upp automatiskt. Priip-produktutvecklaren, Waystone Management Company (IE) Limited, har inte rätt att ensidigt säga upp produkten.

Praktisk information

Förvaringsinstitut Northern Trust International Fund Administration Services (Ireland) Limited.

Mer information Ytterligare information om delfonden kan erhållas från Waystone Management Company (IE) Limited, till exempel prospektet och de senaste årsrapporterna (och halvårsrapporterna). Dessa dokument finns tillgängliga kostnadsfritt på engelska på förvaltningsbolagets webbplats https://funds.waystone.com/public. Emissions- och inlösenkurserna finns tillgängliga när som helst på fondens huvudkontor.

Vilka är riskerna och vad kan jag få för avkastning?

Risk-indikator

Lägre risk ← → **Högre risk**

1	2	3	4	**5**	6	7

Riskindikatorn förutsätter att du behåller produkten i 5 år.

Denna sammanfattande riskindikator är en guide om risknivån för denna produkt jämfört med andra produkter. Den visar hur sannolikt det är att produkten kommer att förlora pengar på grund av marknadsrörelser eller på grund av att vi inte kan betala dig.

Vi har klassificerat denna produkt som 5 av 7, vilket är en medelhög riskklass.

Här bedöms de eventuella förlusterna till följd av framtida resultat ligga på en medelhög nivå och dåliga marknadsförhållanden kommer sannolikt att påverka fondens förmåga att betala dig.

Var uppmärksam på valutarisken Under vissa omständigheter kan du få betalningar i en annan valuta. Den slutliga avkastningen beror därför på växelkursen mellan de två valutorna. Denna risk beaktas inte i indikatorn ovan.

Utöver de risker som ingår i riskindikatorn kan andra risker påverka fondens resultat. Läs mer i fondens prospekt och tillägg, som finns kostnadsfritt på www.waystone.com/.

Avkastningsscenarier

De angivna siffrorna omfattar alla kostnader för själva produkten, men kanske inte omfattar alla de kostnader som du betalar till din rådgivare eller distributör. Siffrorna inbegriper inte din personliga skattesituation, vilken också kan påverka hur mycket du får tillbaka.

Vad du får ut av denna produkt beror på marknadens framtida utveckling. Marknadsutvecklingen i framtiden är osäker och kan inte förutsägas korrekt.

De ogynnsamma, måttliga och gynnsamma scenarier som anges är illustrationer som använder det värsta, genomsnittliga och bästa resultatet för produkten under de senaste 10 åren. Marknaderna kan utvecklas mycket annorlunda i framtiden.

Stresscenariot visar vad du kan få ut under extrema marknadsförhållanden.

Rekommenderad innehavstid		**5 år**	
Exempel på investering		**10.000 USD**	
Scenarier		**Om du löser in efter 1 år**	**Om du löser in efter 5 år** (rekommenderad innehavstid)
Minimum	**Det finns ingen lägsta garanterad avkastning. Du kan förlora en del av eller hela din investering.**		
Stress	**Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader** Genomsnittlig avkastning per år	**3.397 USD** -66,0%	**1.954 USD** -27,9%
Negativt	**Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader** Genomsnittlig avkastning per år	**7.395 USD** -26,1%	**11.269 USD** 2,4%
Neutralt	**Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader** Genomsnittlig avkastning per år	**11.297 USD** 13,0%	**16.898 USD** 11,1%
Positivt	**Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader** Genomsnittlig avkastning per år	**15.679 USD** 56,8%	**23.389 USD** 18,5%

Vad händer om Waystone Management Company (IE) Limited inte kan göra några utbetalningar?

Förvaltningsbolaget har ingen skyldighet att göra utbetalningar eftersom fondens utformning inte beaktar att sådan betalning görs. Du omfattas inte av någon nationell kompensations- eller garantiordning. För att skydda dig innehas tillgångarna av ett separat bolag, ett förvaringsinstitut. Om fonden skulle hamna på obestånd, likviderar förvaringsinstitutet investeringarna och betalar ut behållningen till investerarna. I värsta fall kan du emellertid förlora hela din investering.

Vilka är kostnaderna?

Den person som ger råd om eller säljer denna produkt till dig kan ta ut andra kostnader. Om så är fallet kommer den personen att ge dig information om dessa kostnader och hur de påverkar din investering.

Kostnad på sikt

Tabellerna visar de belopp som tas från din investering för att täcka olika typer av kostnader. Dessa belopp beror på hur mycket du investerar och hur länge du innehar produkten. De belopp som anges här är illustrationer baserade på ett exempel på ett investeringsbelopp och olika möjliga investeringsperioder.

Vi har antagit att du:

- under första året skulle få tillbaka det belopp som du har investerat (0% i årsavkastning). För de övriga innehavsperioderna har vi antagit att produkten ger den avkastning som visas i det måttliga scenariot,
- 10.000 USD investeras.

	Om du löser in efter 1 år	Om du löser in efter 5 år
Totala kostnader	**78 USD**	**533 USD**
Årliga kostnadseffekter*	**0,8%**	**0,9% Varje år**

(*) Detta visar hur kostnader minskar din avkastning varje år under innehavsperioden. Det visar till exempel att om du gör en inlösen vid den rekommenderad innehavsperioden prognostiseras din genomsnittliga avkastning per år att bli 11,9% före kostnader och 11,1% efter kostnader.

Sammanställning av kostnader

Engångskostnader vid teckning eller inlösen		**Om du löser in efter 1 år**
Teckningskostnader	**0,00%**, tar vi inte ut någon teckningsavgift.	**0 USD**
Inlösenkostnader	**0,00%**, vi tar inte ut någon inlösenavgift för denna produkt, men den person som säljer den till dig kan göra det.	**0 USD**
Löpande kostnader som tas ut varje år		**Om du löser in efter 1 år**
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader	**0,74%** av värdet på din investering per år. Detta grundas på en kostnadsuppskattning.	**74 USD**
Transaktionskostnader	**0,04%** av värdet på din investering per år. Detta är en beräkning av de kostnader som uppstått när vi köper och säljer de underliggande investeringarna för produkten. Det faktiska beloppet kommer att variera beroende på hur mycket vi säljer och köper.	**4 USD**
Extra kostnader som tas ut under särskilda omständigheter		**Om du löser in efter 1 år**
Resultatrelaterade avgifter	Någon resultatrelaterad avgift tas inte ut för denna produkt.	**0 USD**

Hur länge bör jag behålla investeringsprodukten och kan jag ta ut pengar i förtid?

Rekommenderad innehavsperiod: 5 år
Denna produkt är avsedd för långsiktiga investeringar. Du bör vara beredd att behålla din investering i minst 5 år. Du kan dock lösa in din investering när som helst under denna period utan straffavgifter eller behålla investeringen längre. Fonden är en fond med daglig handel och investerare kan lösa in andelar på begäran varje handelsdag, i enlighet med vad som anges i fondens tillägg. Detta gäller dock med förbehåll för den lägsta transaktionsgräns som anges i tillägget och i enlighet med prospektet.

Hur kan jag klaga?

Du kan skicka ditt klagomål till förvaltningsbolaget enligt beskrivningen på https://www.waystone.com/waystone-policies. Det går också bra att skicka till följande postadress 35 Shelbourne Rd, Ballsbridge, Dublin, D04 A4E0, Ireland eller via e-post till complianceeurope@waystone.com
Om du har ett klagomål gällande den person som har givit dig råd om produkten eller som sålde den till dig, kommer de att berätta var du ska klaga.

Övrig relevant information

Kostnad, resultat och risk De beräkningar av kostnad, resultat och risk som ingår i detta faktablad följer EU:s bestämmelser.

Avkastningsscenarier Du kan hitta tidigare resultatscenarier, som uppdateras varje månad på https://funds.waystone.com/public.

Tidigare resultat Det saknas tillräckliga resultatuppgifter för att sammanställa ett diagram över tidigare årlig avkastning.

Övrig information Uppgifter om förvaltningsbolagets aktuella ersättningspolicy (inklusive en beskrivning av hur ersättningar och förmåner beräknas och vem/vilka som ansvarar för att tilldela ersättningar och förmåner) finns på www.waystone.com/waystone-policies/. En kostnadsfri papperskopia kan på begäran erhållas från förvaltningsbolaget.

Fonden omfattas av Irlands skattelagstiftning och tillhörande regelverk. Beroende på i vilket land du är bosatt kan det påverka din investering. Kontakta en rådgivare för mer information.