

Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity Ex Grains TR UCITS ETF 1C (EUR)

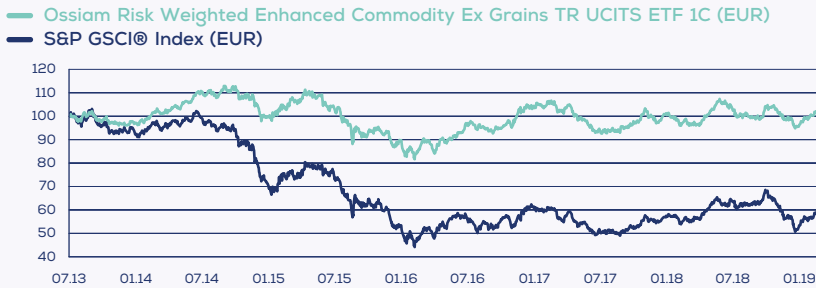
BESCHREIBUNG DER STRATEGIE

Die Risk Weighted Enhanced Commodity Strategie ist ein systematischer Ansatz, der ausschließlich Long-Positionen eingeht und einen umfangreichen Zugang zu den Rohstoffmärkten bietet. Klassische produktionsbasierte Konzepte weisen eine hohe Konzentration im Energiesektor auf und sind einem höheren Risiko von Rollverlusten ausgesetzt. Die Risk Weighted Enhanced Commodity Strategie bietet mit dem Ansatz der Risikogewichtung ein deutlich diversifizierteres Portfolio und reduziert zudem durch einen optimierten Rollierungsansatz potentielle Rollverluste.

Im Einzelnen bietet die Strategie:

- Zugang zu globalen Rohstoffen unter Ausschluss von Getreide bzw. Korn
- Eine deutliche Risikoreduzierung
- Eine erhöhte Diversifizierung sowie eine Optimierung der Rollierung

WERTENTWICKLUNG DES PRODUKTS SEIT AUFLEGUNG 28.02.2019



Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Berechnung durch Ossiam

WERTENTWICKLUNG 28/02/2019

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflegung annualisiert %
Fonds	2,48	6,52	3,79	5,34	0,04	0,29
Index	2,52	6,60	4,19	5,74	0,55	0,84
Investment Universum	4,61	13,59	4,48	6,26	-9,43	-9,02

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Berechnung durch Ossiam

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR 28.02.2019

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	11,49	4,56	0,47	0,03	0,02	-27,71
Index	11,50	5,11	0,47	-	0,07	-27,00
Investment Universum	20,04	-	-	-	-0,45	-57,20

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Berechnung durch Ossiam

WICHTIGE INFORMATION: Der Wert der Investition und das sich aus der Investition ergebende Einkommen wird über die Zeit variieren und kann nicht garantiert werden. ETFs werden wie Aktien an Börsen gehandelt. Die Handelspreise können vom Nettoinventarwert des ETFs abweichen. **Die bisherige Wertentwicklung ist keine Garantie für zukünftige Wertentwicklungen.**

Risikohinweise: Es ist zu beachten, dass der Fonds verschiedenen Risiken ausgesetzt ist. Hierzu gehören unter anderem Risiken aus dem Index, dem Einsatz von Derivaten, dem Gegenpartierisiko und dem Risiko von geographisch konzentrierteren Investitionen. Weitere Risikodetails finden sich im Key Investors Information Document sowie im Fondsprospekt. Diese sind vor einer Investition unbedingt zu sichten. Diese in EUR denominierte Anteilsklasse ist nicht gegen Währungsschwankungen abgesichert.

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR (SRRI)



Der SRRI steht für das Risiko- und Renditeprofil, wie es auch im Key Investor Information Document (KIID) gezeigt wird. Die niedrigste Kategorie kann nicht mit einer risikofreien Anlage gleichgesetzt werden. Der SRRI kann im Laufe der Zeit Veränderungen unterliegen und stellt keine Garantie dar.

INDEXDATEN

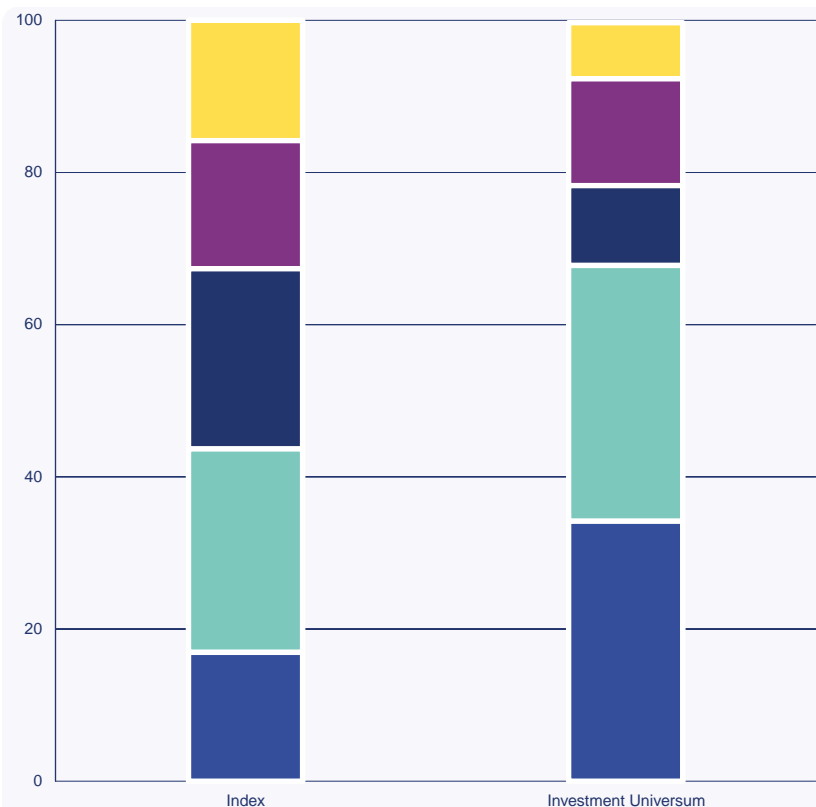
Name	Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR (USD)
Investment Universum	S&P GSCI® Index (USD)
Bloomberg Ticker	OCMDRWT Index
Auflegedatum	25.02.2013
Anlageklasse	Rohstoffe
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

FONDSDATEN

Depotbank	State Street Bank Luxembourg S.A
Rechtsform	Sub fund of Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	USD 53.517.868
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 40.807.233
Nettoinventarwert	EUR 71.749
Anzahl der Anteile	568.750
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU0876440578
Auflegedatum	05.07.2013
Replikationsmethode	Synthetisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Sonstiger Fonds
Gesamtkostenquote	0,45%

HANDELSINFORMATION

Cut-off	16:00 Uhr (Luxemburger Zeit)
Mindestinvestment (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil
XETRA Ticker	
Bloomberg Ticker	OSXC GR



Rohstoff Allokation (28.02.2019)

- Agrarrohstoffe
- Energierohstoffe
- Industriemetalle
- Viehwirtschaft
- Edelmetalle

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Berechnung durch Ossiam

TOP 10 POSITIONEN (%)
28.02.2019

Position	Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR (%)
S&P GSCI GOLD DYNAMIC ROLL INDEX ER	10,01
S&P GSCI LIVE CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	7,35
S&P GSCI FEEDER CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	6,52
S&P GSCI NATURAL GAS DYNAMIC ROLL INDEX ER	6,23
S&P GSCI COPPER DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,97
SILVER DYNAMIC ER	5,80
S&P GSCI COTTON DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,29
S&P GSCI ALUMINUM DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,21
S&P GSCI GASOIL DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,08
S&P GSCI HEATING OIL DYNAMIC ROLL INDEX ER	4,49

Position	S&P GSCI® Index (%)
S&P GSCI CRUDE OIL INDEX TR	16,73
S&P GSCI CORN INDEX TR	11,85
S&P GSCI LIVE CATTLE TR	10,69
S&P GSCI SOYBEAN INDEX TR	7,93
S&P GSCI COPPER INDEX TR	7,70
S&P GSCI WHEAT INDEX TR	7,17
S&P GSCI BRENT CRUDE INDEX TR	6,46
S&P GSCI GOLD INDEX TR	6,44
S&P GSCI HEATING OIL INDEX TR	4,28
S&P GSCI SUGAR INDEX TR	3,53

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Berechnung durch Ossiam

KONTAKT / INFO

www.ossiam.com

mail : info@ossiam.com

TEL +33 1 84 79 42 70

80 av. de la Grande Armée

75017 PARIS - FRANCE

Dieses Dokument hat einen wirtschaftlichen und keinen regulatorischen Hintergrund.

Ossiam Lux (der SICAV) ist als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital nach dem Gesetz des Großherzogtums Luxemburg eingetragen und wurde von der Luxemburger Marktaufsicht CSSF. Damit ist Ossiam verantwortlich für das Investment-Management, die Verwaltung und den Vertrieb der SICAV. Die Verwaltungsgesellschaft hat State Street Luxembourg zur Verwaltungsstelle, Zahlstelle, Domizilierungsstelle sowie zum Vertreter der Gesellschaft, Registerführer und zur Transferstelle der SICAV ernannt. Ossiam, eine Tochtergesellschaft von Natixis Investment Managers (ehemals Natixis Global Asset Management), ist eine französische Kapitalanlagegesellschaft, die von der Autorité des Marchés Financiers (Zulassungnr. GP-10000016) zugelassen ist. Für die Vermarktung in Deutschland zugelassen.

Der OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR wird durch Standard & Poor's Financial Services LLC („S&P“), seine verbundenen Unternehmen und deren externe Lizenzgeber nicht gesponsert, unterstützt, verkauft oder beworben. S&P, seine verbundenen Unternehmen und deren externe Lizenzgeber übernehmen gegenüber den Anteilseignern des OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR oder gegenüber einem Mitglied der Öffentlichkeit keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Zusicherung oder Gewährleistung bezüglich der Zweckmäßigkeit, in Wertpapiere im Allgemeinen oder in den OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR im Besonderen zu investieren, oder bezüglich der Eignung des Ossiam World Minimum Variance Index Net Return (der „Index“), die allgemeine Aktienmarktentwicklung abzubilden. Die einzige Beziehung von S&P und seinen externen Lizenzgebern mit Ossiam besteht in der Lizenzierung bestimmter Warenzeichen, Dienstleistungsmarken und Handelsnamen von S&P und/oder seinen externen Lizenzgebern und der Durchführung von Berechnungen sowie der Erbringung von Dienstleistungen im Zusammenhang mit dem Index. S&P, seine verbundenen Unternehmen und deren externe Lizenzgeber sind nicht verantwortlich für die Festlegung der Kurse und des Betrags des OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR oder die Bestimmung des Zeitpunkts der Ausgabe oder des Verkaufs des OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR oder die Festlegung oder Berechnung der Gleichung, mit der der OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR in Barmittel umzuwandeln ist, und waren nicht an diesen Festlegungen, Bestimmungen und Berechnungen beteiligt. S&P übernimmt keine Verpflichtung oder Haftung in Zusammenhang mit der Verwaltung, der Vermarktung oder dem Handel des Ossiam World Minimum Variance NR. S&P, seine verbundenen Unternehmen und deren externe Lizenzgeber übernehmen keine Garantie für die Eignung, Genauigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit des Index, der darin enthaltenen Daten oder diesbezüglicher Mitteilungen jeglicher Art, einschließlich mündlicher oder schriftlicher Mitteilungen (einschließlich elektronisch übermittelter Mitteilungen). S&P, seine verbundenen Unternehmen und deren externe Lizenzgeber haften nicht für darin enthaltene Fehler, Auslassungen oder Verzögerungen. S&P gibt im Hinblick auf seine Warenzeichen, den Index oder jegliche darin enthaltene Daten keine ausdrückliche oder stillschweigende Zusicherung für die Marktauglichkeit oder betreffend der Eignung für einen bestimmten Zweck oder eine bestimmte Verwendung ab und lehnt ausdrücklich jegliche diesbezüglichen Gewährleistungen ab, ohne Einschränkung des vorstehenden Haftung S&P, seine verbundenen Unternehmen oder deren Lizenzgeber auf keinen Fall für indirekte Schäden, besondere Schäden, zufällige Schäden, Strafschadenersatz oder Folgeschäden (einschließlich entgangener Gewinne, Handelsverluste, Zeitverlust oder Goodwill), sei dies aufgrund der vertraglichen Haftung, der ausservertraglichen Haftung, der Gefährdungshaftung oder sonstiger Grundlagen, selbst wenn sie von der Möglichkeit solcher Schäden in Kenntnis gesetzt worden sein sollten.

Standard & Poor's® und S&P® sind eingetragene Warenzeichen von Standard & Poor's Financial Services LLC. „Calculated by S&P Custom Indices“ und die damit verbundene stilisierte Marke sind Dienstleistungsmarken von Standard & Poor's Financial Services LLC und wurden für die Verwendung durch Ossiam lizenziert.

DER ZUGANG ZU PRODUKTEN UND DIENSTLEISTUNGEN IN DIESER PRÄSENTATION KANN FÜR BESTIMMTE PERSONEN ODER LÄNDER RESTRIKTIONEN AUFWEISEN. DIES KANN SICH AUS GENERELLEN REGELUNGEN ODER AUS MARKETINGGRÜNDEN ERGEBEN. KEIN PRODUKT UND KEINE DIENSTLEISTUNG AUS DIESEM DOKUMENT DARF DAHER EINER PERSON ANGEBOTEN WERDEN, DIE HIERZU RECHTLICH NICHT AUTORISIERT IST. DASSELBE GILT FÜR LÄNDER, IN DENEN OSSIAM NICHT FÜR DEN VERTRIEB ODER DAS MARKETING AUTORISIERT IST.