

Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)

BESCHREIBUNG DER STRATEGIE

Die Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Strategie ist eine systematische Value-Strategie, die auf den Forschungsarbeiten von Professor Robert Shiller basiert. Die Strategie ermöglicht die Investition in einen Sektor-Selektions-Ansatz, welcher basierend auf dem Cyclically Adjusted Price-to-Earnings (CAPE) Ratio potentiell unterbewertete Sektoren identifiziert. Zielsetzung der Strategie ist die Bereitstellung eines Portfolios, welches tendenziell aus Unternehmen mit einer höheren Marktkapitalisierung und einem Value-Bias besteht. Die Strategie ist insbesondere für Investoren mit einem mehrjährigen Investitionshorizont geeignet.

Im Einzelnen bietet die Strategie:

- Positionen in US Aktien mit einem Sektor-Selektions-Ansatz basierend auf dem CAPE Ratio
- Einen weltweit genutzten Bewertungsansatz basierend auf den Forschungsarbeiten von Professor Shiller
- Einen Investmentprozess, der über einen langfristigen Investitionshorizont potentiell unterbewertete Sektoren identifiziert

WERTENTWICKLUNG DES PRODUKTS SEIT AUFLEGUNG 28.02.2019

— Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)
 — S&P 500® Index NR (EUR)



Ossiam/Bloomberg/Barclays, Berechnung durch Ossiam

WERTENTWICKLUNG 28/02/2019

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflegung annualisiert %
Fonds	4,34	12,48	12,22	14,33	—	12,30
Index	4,40	12,67	13,11	14,96	17,62	12,88
Investment Universum	3,93	11,79	11,45	12,67	14,31	9,23

Ossiam/Bloomberg/Barclays, Berechnung durch Ossiam

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR 28.02.2019

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	16,94	3,20	0,99	0,07	0,73	-19,33
Index	16,94	3,78	0,99	—	0,76	-19,21
Investment Universum	16,91	—	—	—	0,55	-18,49

Ossiam/Bloomberg/Barclays, 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 Gegenparteirisiko 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

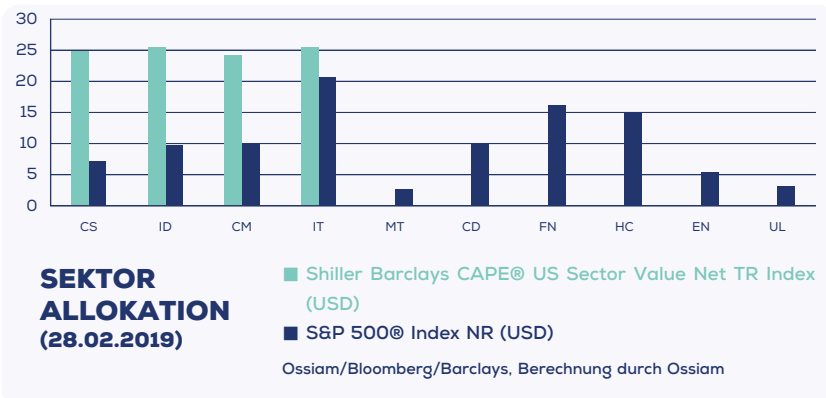
Name	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index (USD)
Investment Universum	S&P 500® Index NR (USD)
Bloomberg Ticker	BXIIUCSU Index
Auflegedatum	05.10.2012
Anlageklasse	Aktie
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

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 1.656.802.223
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 445.846.976
Nettoinventarwert	EUR 590.518
Anzahl der Anteile	755.010
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU1079841273
Auflegedatum	22.06.2015
Replikationsmethode	Synthetisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Gesamtkostenquote	0,65%

HANDELSINFORMATION

Cut-off	4:00 pm Luxembourg time
Mindestinvestment (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil
XETRA Ticker	
Bloomberg Ticker	USCP GR



MT: Materials • CS: Consumer Staples • CD: Consumer Discretionary • FN: Financial and Real Estate • HC: Health Care • ID: Industrials • EN: Energy • CM: Communications Services • IT: Information Technology • UL: Utilities

TOP 10 POSITIONEN (%)

28.02.2019

	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index	S&P 500® Index NR
MICROSOFT CORP	4,57	3,70
FACEBOOK INC-A	4,34	1,66
APPLE INC	4,12	3,34
PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,65	1,05
ALPHABET INC-CL C	2,86	1,47
ALPHABET INC-CL A	2,80	1,44
BOEING CO/THE	2,59	0,99
COCA-COLA CO/THE	2,58	0,74
PEPSICO INC	2,43	0,70
WALMART INC	2,10	0,60

Ossiam/Bloomberg/Barclays, 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.

Barclays Bank PLC und seine verbundenen Unternehmen (Barclays) sind weder Emittent noch Urheber des OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR und Barclays übernimmt keine Verantwortung, Verpflichtungen oder Pflichten gegenüber Anlegern im OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR außer auf der Basis eines mit BARCLAYS geschlossenen Vertrages zum Vertrieb dieser Produkte. Der Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index ist eine Handelsmarke der Barclays Bank PLC oder ihrer hundertprozentigen Tochtergesellschaft Barclays Capital Inc. und wurde OSSIAM als Emittentin des OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR per Lizenz zur Nutzung überlassen. Während OSSIAM als Emittent der OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR in eigenem Interesse mit Barclays Transaktionen mit oder bezüglich des Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index in Verbindung mit dem OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR durchführen, jedoch erwerben alle Anleger ihre Anteile des OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR vom OSSIAM und keinen wirtschaftlichen Anteil am OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR und gehen durch eine Anlage im Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index keinerlei Beziehung mit Barclays ein. Der OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR wird nicht von Barclays gesponsort, empfohlen, verkauft oder beworben und Barclays gibt keine ausdrücklichen oder stillschweigenden Zusicherungen oder Garantien hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage im OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR ab oder im Hinblick auf den Gebrauch oder ein Investment in Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index. Ausgenommen hiervon ist der Vertrieb auf der Grundlage eines zwischen OSSIAM und Barclays geschlossenen Vertrages. Barclays übernimmt keine Verantwortung oder Haftung gegenüber der Emittentin, den Anlegern oder sonstigen Dritten hinsichtlich der Verwendung oder Genauigkeit und/oder Vollständigkeit des Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Indexoder darin enthaltener Daten. Diese geben keine Stellungnahme zur Beratung über Investitionen in SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR.

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.