

## Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

### BESCHREIBUNG DER STRATEGIE

Die Minimum Variance Strategie zielt darauf ab, die Volatilität im Vergleich zu einem marktkapitalisierungsgewichteten Index zu reduzieren und gleichzeitig eine hohe Diversifikation beizubehalten.

Basierend auf Schätzungen der Volatilitäten der Aktien sowie den Korrelationen untereinander wird ein Portfolio zusammengestellt, dass ausschließlich aus Long-Positionen besteht und einen defensiven Charakter aufweist.

Der Strategieansatz ist insbesondere für solche Investoren geeignet, die über einen mehrjährigen Investitionshorizont in Aktien investieren wollen, gleichzeitig jedoch eine reduzierte Volatilität suchen.

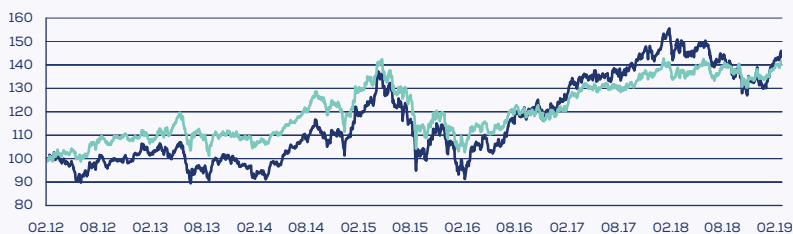
Im Einzelnen bietet die Strategie:

- Investmentpositionen in der Aktienprämie
- Eine Reduzierung von Volatilität
- Profitierung von der sogenannten Low-Volatility-Anomalie

### WERTENTWICKLUNG DES PRODUKTS SEIT AUFLEGUNG

28.02.2019

— Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)  
— SP/IFCI® Composite NR (EUR)



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	1,04	3,80	0,95	8,36	5,34	4,87
Index	1,19	4,12	2,66	10,15	7,12	6,64
Investment Universum	1,14	8,87	-3,78	13,31	8,70	5,22

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	12,42	0,94	0,75	0,08	0,39	-27,92
Index	12,43	2,70	0,75	—	0,53	-27,05
Investment Universum	14,92	—	—	—	0,35	-33,50

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 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	Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)
Investment Universum	SP/IFCI® Composite NR (USD)
Bloomberg Ticker	OEMMVNR Index
Auflegedatum	24.01.2012
Anlageklasse	Aktie
Häufigkeit der Neugewichtung	Halbjährlich

### 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 137.569.785
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 116.506.202
Nettoinventarwert	EUR 111.653
Anzahl der Anteile	1.043.464
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU0705291903
Auflegedatum	03.02.2012
Replikationsmethode	Synthetisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Gesamtkostenquote	0,75%

### HANDELSINFORMATION

Cut-off	16:00 Uhr (Luxemburger Zeit) (T-1)
Mindestinvestment (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil

### XETRA Ticker

Bloomberg Ticker	OSX9 GR
------------------	---------

## > Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

### TOP 10 POSITIONEN (%) 28.02.2019

	Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR	SP/IFCI® Composite NR
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,77	0,08
TENAGA NASIONAL BHD	2,66	0,14
PUBLIC BANK BHD	2,60	0,25
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,56	0,21
SIAM CEMENT PCL/THE	2,18	0,07
CHINA MOBILE LTD	2,02	0,93
CP ALL PCL	1,94	0,17
BANGKOK DUSIT MED SERVICE	1,90	0,05
QATAR NATIONAL BANK	1,82	0,37
MALAYAN BANKING BHD	1,78	0,19

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

### KONTAKT / INFO

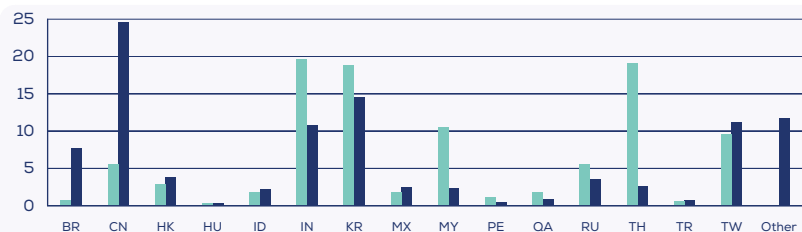
[www.ossiam.com](http://www.ossiam.com)

mail : [info@ossiam.com](mailto:info@ossiam.com)

TEL +33 1 84 79 42 70

80 av. de la Grande Armée

75017 PARIS - FRANCE



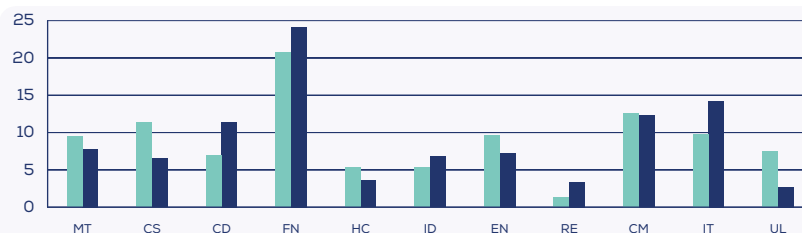
### REGIONALE ALLOKATION (28.02.2019)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)

■ SP/IFCI® Composite NR (USD)

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Berechnung durch Ossiam

BR: Brazil • CN: China • HK: Hong Kong • HU: Hungary • ID: Indonesia • IN: India • KR: Korea • MX: Mexico • MY: Malaysia • PE: Peru • QA: Qatar • RU: Russian Federation • TH: Thailand • TR: Turkey • TW: Taiwan



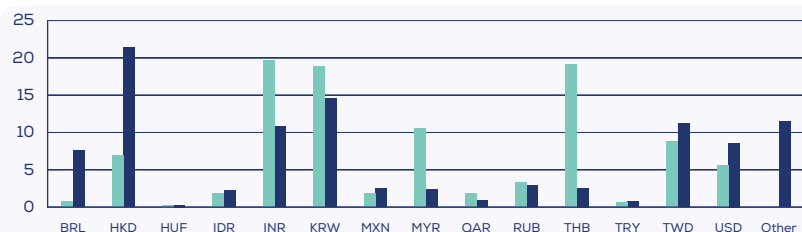
### SEKTOR ALLOKATION (28.02.2019)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)

■ SP/IFCI® Composite NR (USD)

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

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



### WÄHRUNGS-ALLOKATION (28.02.2019)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)

■ SP/IFCI® Composite NR (USD)

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

BRL: Brazil Real • HKD: Hong Kong Dollar • HUF: Hungarian Forint • IDR: Indonesian Rupiah • INR: Indian Rupiah • KRW: South Korean Won • MXN: Mexican Peso • MYR: Malaysian Ringgit • QAR: Qatar Riyal • RUB: Russian Ruble • THB: Thai Baht • TRY: Turkish Lira • TWD: Taiwan New Dollar • USD: US Dollar

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 Natix Investment Managers (ehemals Natix Global Asset Management), ist eine französische Kapitalanlagegesellschaft, die von der Autorité des Marchés Financiers (Zulassungsnr. GP-10000016) zugelassen ist. Für die Vermarktung in Deutschland zugelassen.

Der OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR 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 EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR oder gegenüber einem Mitglied der Öffentlichkeit keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Zusicherung oder Gewährleistung bezüglich der Zweckmäßigkeit, in Wertpapieren im Allgemeinen oder in den OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR im Besonderen zu investieren, oder bezüglich der Eignung des Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index Net Return USD (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 EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR oder die Bestimmung des Zeitpunkts der Ausgabe oder des Verkaufs des OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR oder die Festlegung oder Berechnung der Gleichung, mit der der OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR 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 EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR

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.