

Ossiam Japan 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 aus der sogenannten Low-Volatility-Anomalie

WERTENTWICKLUNG DES PRODUKTS SEIT AUFLEGUNG

28.02.2019

— Ossiam Japan Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)
— S&P/TOPIX 150 Net TR Index (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	0,56	6,08	-0,09	7,44	-	5,32
Index	0,61	6,19	0,54	8,24	12,21	6,12
Investment Universum	0,75	7,40	-3,43	8,27	-	4,38

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	15,45	1,78	0,81	0,12	0,34	-15,60
Index	15,46	2,58	0,81	-	0,40	-15,51
Investment Universum	17,83	-	-	-	0,25	-20,37

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 Anteilklasse 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	Japan Minimum Variance Index NR (JPY)
Investment Universum	S&P/TOPIX 150 Net TR Index (JPY)
Bloomberg Ticker	JPMVNR Index
Auflegedatum	05.10.2015
Anlageklasse	Aktie
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

FONDSDATEN

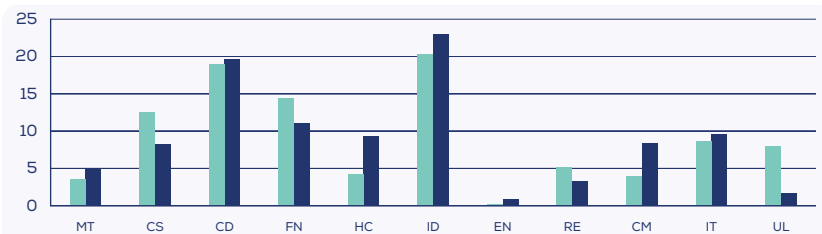
Depotbank	State Street Bank Luxembourg S.A
Rechtsform	Sub fund of Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	JPY 2.385.002.376
Anlagevolumen der Anteilklasse	EUR 18.815.081
Nettoinventarwert	EUR 101,367
Anzahl der Anteile	185.613
Fondswährung	JPY
Währung der Anteilklasse	EUR
ISIN	LU1254453738
Auflegedatum	21.12.2015
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Gesamtkostenquote	0,65%

HANDELSINFORMATION

Cut-off	17:00 Uhr (Luxemburger Zeit) (T-1)
Mindestinvestment (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil

XETRA Ticker

Bloomberg Ticker	OSXJ GR
------------------	---------



SEKTOR ALLOKATION (28.02.2019)

■ Japan Minimum Variance Index NR (JPY)

■ S&P/TOPIX 150 Net TR Index (JPY)

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

TOP 10 POSITIONEN (%) 28.02.2019

	Japan Minimum Variance Index NR	S&P/TOPIX 150 Net TR Index
JAPAN TOBACCO INC	3,68	0,97
MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES	3,57	0,47
TOSHIBA CORP	3,53	0,63
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	3,49	1,36
KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC	3,47	0,19
NITORI HOLDINGS CO LTD	3,37	0,38
JAPAN AIRLINES CO LTD	3,11	0,43
NEC CORP	2,79	0,30
ANA HOLDINGS INC	2,63	0,44
M&S&D INSURANCE GROUP HOLDIN	2,61	0,52

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.

OSSIAM hat S&P Opco LLC, eine Tochtergesellschaft von S&P Dow Jones Indices, mit der Berechnung und Pflege des JAPAN MINIMUM VARIANCE INDEX NR und des JAPAN MINIMUM VARIANCE EURO HEDGED INDEX NR (die „Indizes“) beauftragt. Die Indizes werden durch S&P Dow Jones Indices LLC, ihre verbundenen Unternehmen oder externe Lizenzgeber, darunter Standard & Poor's Financial Services LLC und Dow Jones Trademark Holdings LLC (zusammen „S&P Dow Jones Indices“) nicht gesponsert. S&P Dow Jones Indices haftet nicht für Fehler oder Auslassungen bei der Berechnung der Indizes. „Calculated by S&P Custom Indices“ und die damit verbundene(n) stilisierte(n) Marke(n) sind Dienstleistungsmarken von S&P Dow Jones Indices und wurden für die Verwendung durch Ossiam lizenziert. S&P® ist ein eingetragenes Warenzeichen von Standard & Poor's Financial Services LLC, und Dow Jones® ist ein eingetragenes Warenzeichen von Dow Jones Trademark Holdings LLC. S&P Dow Jones indices übernimmt keine garantie für die eignung, genauigkeit, aktualität und/oder vollständigkeit der indizes, damit zusammenhängender daten oder diesbezüglicher mitteilungen jeglicher art, einschliesslich mündlicher, schriftlicher oder elektronisch übermittelter mitteilungen. S&P Dow Jones indices haftet nicht für darin enthaltene fehler, auslassungen oder verzögerungen. S&P Dow Jones indices übernimmt im hinblick auf den index oder jegliche darin enthaltene daten keineausdrückliche oder stillschweigende gewährleistung betreffend der markttauglichkeit, der eignung für einen bestimmten zweck oder eine bestimmte verwendung oder betreffend der von ossiam, den anteilseignern des fonds oder jeder anderen natürlichen ODER juristischen person aus der verwendung der indizes erzielbaren ergebnisse und lehnt ausdrücklich jegliche diesbezüglichen gewährleistungen ab, ohne einschränkung des vorstehenden haftet S&P Dow Jones indices 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 S&P Dow Jones indices von der möglichkeit solcher schäden in kenntnis gesetzt worden sein sollte.

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.