

Ossiam Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit UCITS ETF 1C (EUR)

BESCHREIBUNG DER STRATEGIE

Der Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index bildet, basierend auf den Kreditrisiko-Kennzahlen von Moody's, die Wertentwicklung einer Auswahl von 100 Unternehmensanleihen aus dem Solactive Euro IG Corporate Index ("Benchmark") ab.

Ziel des Index ist die Auswahl eines gleich gewichteten Portfolios von 100 liquiden Anleihen, die den von Moody's Analytics berechneten und bereitgestellten quantitativen Kennzahlen zufolge als unterbewertet gelten und gemäß der EDF™ (1) eine geringe zu erwartende Kreditausfallwahrscheinlichkeit aufweisen. Ferner weist das Portfolio dasselbe Zinsrisiko sowie dasselbe Branchenrisiko wie die Benchmark auf. Die Gewichtung des Duration Buckets sowie die Gewichtung von Finanz- und Nicht-Finanz-Anleihen stimmen also mit den entsprechenden Gewichtungen in der Benchmark überein.

Die Strategie schreibt eine maximale Gewichtung von 5% pro Emittent vor. Die Auswahl wird vierteljährlich überprüft.

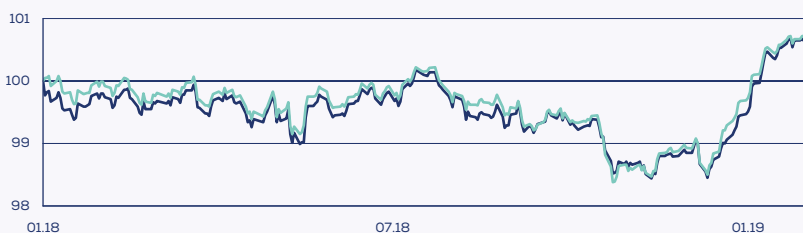
Die Strategie hat folgende Ziele:

- Adressierung der Ineffizienzen klassischer Unternehmensanleihen-Benchmarks
- Wahrung eines niedrigen Kreditrisikos
- Maximierung der Gesamterträge einer liquiden und diversifizierten Auswahl von auf Euro lautenden Investment-Grade-Unternehmensanleihen

(1) EDF™ (Expected Default Frequency): Eine zukunftsgerichtete Messgröße für die Ausfallwahrscheinlichkeit auf der Grundlage des EDFTM-Modells von Moody's Analytics für börsennotierte Unternehmen, bei dem die Bewertung des Ausfallrisikos auf kursrelevanten Informationen sowie auf Bilanzkennzahlen basiert.

WERTENTWICKLUNG DES PRODUKTS SEIT AUFLEGUNG 28.02.2019

— Ossiam Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit UCITS ETF 1C (EUR)
 — Solactive Euro IG Corporate Index (EUR)



Ossiam/Moody's Analytics/Solactive, Berechnung durch Ossiam

WERTENTWICKLUNG 28/02/2019

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflegung annualisiert %
Fonds	0,63	1,81	0,72	–	–	0,33
Index	0,66	1,88	1,20	2,24	2,80	0,82
Investment Universum	0,73	1,80	0,84	2,22	2,59	0,48

Ossiam/Moody's Analytics/Solactive, Berechnung durch Ossiam

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR 28.02.2019

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	1,58	-0,10	0,90	0,02	0,21	-2,19
Index	1,58	0,39	0,90	–	0,52	-1,78
Investment Universum	1,68	–	–	–	0,28	-1,94

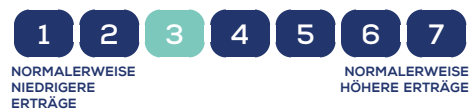
Ossiam/Moody's Analytics/Solactive, Berechnung durch Ossiam

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.

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR (SRRI)

NIEDRIGE RISIKEN ← → HOHE RISIKEN



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	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index (EUR)
Investment Universum	Solactive Euro IG Corporate Index (EUR)
Bloomberg Ticker	SOLMASCRI Index
Auflegedatum	22.11.2017
Anlageklasse	Fixed Income
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	EUR 41.200.911
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 41.200.911
Nettoinventarwert	EUR 179.566
Anzahl der Anteile	229.447
Fondswährung	EUR
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU1093307442
Auflegedatum	29.12.2017
Replikationsmethode	Synthetic
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Gesamtkostenquote	0,35%

HANDELSINFORMATION

Cut-off	15:45 Uhr (Luxemburger Zeit)
Mindestinvestment (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil
XETRA Ticker	
Bloomberg Ticker	OSXF GY

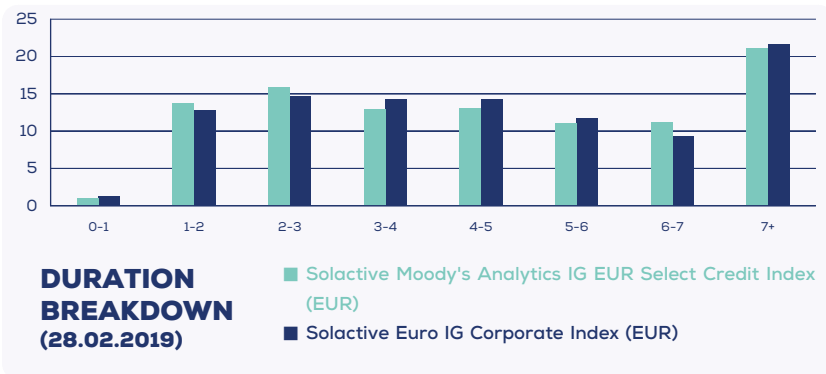
TOP 10 POSITIONEN (%)
28.02.2019

	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index	Solactive Euro IG Corporate Index
BRK 1 5/8 03/16/35	1,03	0,05
TALANX 2 1/4 12/05/47	1,03	0,03
BOND ASSICURAZIONI GENERALI 2026-05-04 4.125	1,03	0,05
ACAFP 2 5/8 03/17/27	1,03	0,10
FFHCN 2 3/4 03/29/28	1,03	0,03
BRK 2.15 03/15/28	1,02	0,04
ASSGEN 5 06/08/48	1,02	0,04
SANTAN 2 1/2 03/18/25	1,02	0,08
ENELIM 5 5/8 06/21/27	1,02	0,06
BRK 1 1/8 03/16/27	1,02	0,06

PORTFOLIOMERKMALE
(28.02.2019)

	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index	Solactive Euro IG Corporate Index
Duration (in years)	4,82	4,97
Adjusted Duration (in years)	4,76	4,91
EDF (Expected Default Frequency) %	NaN	NaN
Yield to Maturity %	1,03	1,06

Ossiam/Moody's Analytics/Solactive, 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.

„Das Finanzinstrument wird von der Solactive AG weder gesponsert noch beworben, verkauft oder auf sonstige Weise gefördert, und die Solactive AG gibt zu keiner Zeit eine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung im Hinblick auf die Ergebnisse einer Nutzung des Index und/oder der Indexmarke oder des Indexpreises oder in anderer Hinsicht. Der Index wird von der Solactive AG berechnet und veröffentlicht. Die Solactive AG bemüht sich, sicherzustellen, dass der Index richtig berechnet wird. Unabhängig von ihren Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten ist die Solactive AG nicht verpflichtet, Fehler im Index gegenüber Dritten anzuzeigen, insbesondere gegenüber Anlegern und/oder Finanzmittlern des Finanzinstruments. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung des Index oder der Indexmarke zur Nutzung in Verbindung mit dem Finanzinstrument stellen eine Empfehlung durch die Solactive AG zur Investition von Kapital in das entsprechende Finanzinstrument dar und sie stellen auch in keiner Weise eine Zusicherung oder Meinung der Solactive AG im Hinblick auf eine Investition in dieses Finanzinstrument dar.“

„Der Fonds wird von Moody's Analytics weder gesponsert noch beworben, verkauft oder auf sonstige Weise gefördert und Moody's Analytics gibt zu keiner Zeit eine vertragliche oder gesetzliche Garantie oder Zusicherung im Hinblick auf die Ergebnisse einer Nutzung des Index und/oder der Marke oder der Daten von Moody's Analytics oder in anderer Hinsicht ab. Bestimmte quantitative Finanzdaten, welche die Solactive AG bei der Berechnung und Veröffentlichung des Index verwendet, werden von Moody's Analytics zur Verfügung gestellt. Unbeschadet ihrer Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten und der Solactive AG ist Moody's Analytics nicht verpflichtet, Fehler im Index gegenüber Dritten, wie unter anderem Anlegern und/oder Finanzmittlern des Fonds, anzuzeigen. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung der Daten oder des Warenzeichens von Moody's Analytics zur Nutzung in Verbindung mit dem Index und dem Fonds stellen eine Empfehlung durch Moody's Analytics zur Investition von Kapital in den Fonds dar, und sie stellen auch in keiner Weise eine Zusicherung oder Meinung von Moody's Analytics im Hinblick auf eine Investition in dieses Finanzinstrument dar.“