

## Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF 1C (EUR)

### BESCHREIBUNG DER STRATEGIE

Die ESG 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, das ausschließlich aus Long-Positionen besteht und einen defensiven Charakter aufweist.

Weiterhin wird basierend auf einem ESG-Filter-Ansatz ausschließlich in solche Unternehmen investiert, die innerhalb eines jeden Wirtschaftszweiges zu den 70% mit der besten ESG-Bewertungen gehören. Gleichzeitig erfolgt ein Ausschluss von solchen Unternehmen, die in der Vergangenheit aus ESG-Sicht besondere Kontroversen oder Einzelereignisse aufwiesen.

Der Strategieansatz ist insbesondere für solche Investoren geeignet, die über einen mehrjährigen Investitionshorizont in Aktien investieren wollen, gleichzeitig jedoch eine reduzierte Volatilität suchen und besonderen Wert auf eine ESG-Ausrichtung legen.

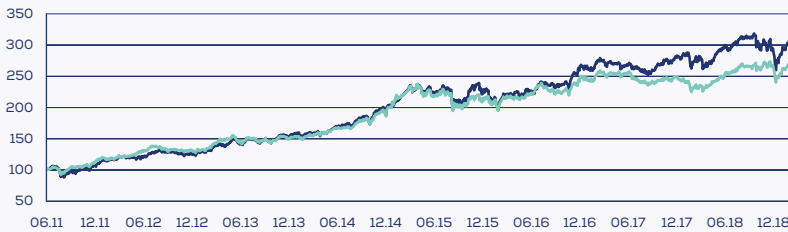
Im Einzelnen bietet die Strategie:

- Investmentpositionen in der Aktienprämie mit einer hohen ESG-Ausrichtung
- Eine Reduzierung von Volatilität
- Profitierung von der sogenannten Low-Volatility-Anomalie

### WERTENTWICKLUNG DES PRODUKTS SEIT AUFLEGUNG

28.02.2019

— Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF 1C (EUR)  
 — Solactive US Large Cap Net TR Index\* (EUR)



Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, Berechnung durch Ossiam

### WERTENTWICKLUNG

28/02/2019

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflegung annualisiert %
Fonds	3,68	9,18	17,13	8,55	11,96	13,92
Index	3,75	9,34	17,66	8,93	12,20	14,18
Investment Universum	4,02	11,94	11,67	12,73	14,34	15,80

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, Berechnung durch Ossiam

### SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR

28.02.2019

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	13,15	2,06	0,75	0,40	1,06	-18,13
Index	13,15	2,31	0,75	—	1,08	-18,16
Investment Universum	16,15	—	—	—	0,98	-18,46

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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.  
 \*Bis zum 16. Juni 2017 basiert die Kalkulation des Referenzindex auf dem Ossiam US Minimum Variance Index NR, anschließend auf der Wertentwicklung des US ESG Minimum Variance NR Index. Die Kalkulation der Benchmark basiert bis zum 16. Juni 2017 auf dem S&P 500 Index NR und anschließend auf dem Solactive US Large Cap NR Index. Die Umstellung der Kalkulationen von Referenzindex und Benchmark erfolgte am 16. Juni 2017 zum Börsenschluss.

### 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	US ESG Minimum Variance Index NR * (USD)
Investment Universum	Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)
Bloomberg Ticker	ESGUSMVN
Auflegedatum	06.06.2011
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 369.257.325
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 126.634.343
Nettoinventarwert	EUR 183,255
Anzahl der Anteile	691.029
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU0599612685
Auflegedatum	15.06.2011
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Gesamtkostenquote	0,65%

### HANDELSINFORMATION

Cut-off	16:15 Uhr (Luxemburger Zeit)
Mindestinvestment (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil
XETRA Ticker	
Bloomberg Ticker	OSX2 GR

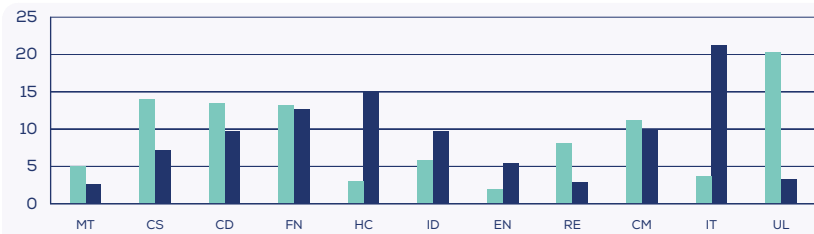
**TOP 10 POSITIONEN (%)**  
28.02.2019

	US ESG Minimum Variance Index NR * (USD)	Solactive US Large Cap Net TR Index*	ESG Rating
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	4,46	0,23	50,37
NEWMONT MINING CORP	4,45	0,08	78,08
SEMPRA ENERGY	3,17	0,13	69,16
CME GROUP INC	3,09	0,28	53,25
AUTOZONE INC	3,04	0,10	52,16
REPUBLIC SERVICES INC	2,99	0,07	54,88
MCDONALD'S CORP	2,89	0,61	57,37
HERSHEY CO/THE	2,67	0,07	65,77
CITRIX SYSTEMS INC	2,63	0,06	57,12
DUKE ENERGY CORP	2,56	0,27	63,09

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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

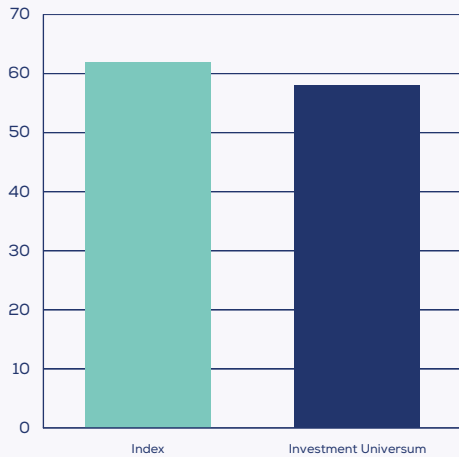


**SEKTOR ALLOKATION**  
(28.02.2019)

■ US ESG Minimum Variance Index NR\* (USD)  
■ Solactive US Large Cap Net TR Index\* (USD)

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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



**DURCHSCHNITTLICHES ESG-RATING**  
(28.02.2019)

■ US ESG Minimum Variance Index NR\* (USD)  
■ Solactive US Large Cap Net TR Index\* (USD)

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, Berechnung durch Ossiam

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 OSSIAM US ESG MINIMUM VARIANCE NR 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 ist nach Kräften bestrebt sicherzustellen, dass der Index richtig berechnet wird. Unbeschadet ihrer Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten ist die Solactive AG nicht verpflichtet, Fehler im Index bei Dritten, wie unter anderem Anlegern und/oder Finanzmittlern des Finanzinstruments, anzuzeigen. 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 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.