

Ossiam World 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.

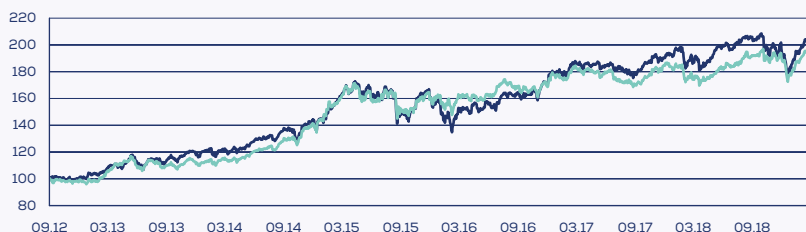
Im Einzelnen bietet die Strategie:

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

WERTENTWICKLUNG DES PRODUKTS SEIT AUFLEGUNG

28.02.2019

— Ossiam World Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)
 — S&P Global 1200® Index 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	3,20	9,62	9,95	7,07	11,24	10,87
Index	3,25	9,76	10,99	7,76	11,84	11,48
Investment Universum	3,58	11,04	7,05	11,15	10,83	11,58

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	11,44	2,02	0,76	0,35	0,95	-15,36
Index	11,44	2,62	0,77	—	1,00	-15,26
Investment Universum	13,23	—	—	—	0,88	-22,06

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 World Minimum Variance Index NR (USD)
Investment Universum	S&P Global 1200® Index NR (USD)
Bloomberg Ticker	OWMVNR Index
Auflegedatum	16.07.2012
Anlageklasse	Aktie
Häufigkeit der Neugewichtung	Halbjährlich

FONDSDATEN

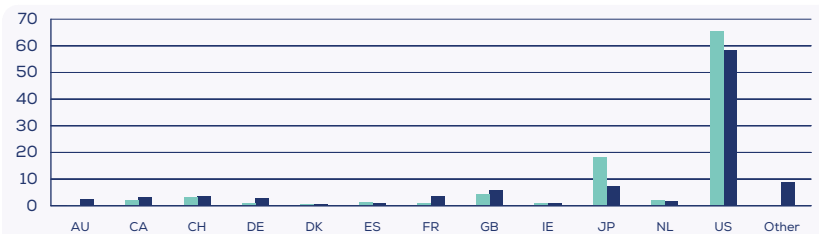
Depotbank	State Street Bank Luxembourg S.A
Rechtsform	Sub fund of Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	USD 20.131.146
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 13.271.748
Nettoinventarwert	EUR 161.429
Anzahl der Anteile	82.214
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU0799656698
Auflegedatum	04.09.2012
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Gesamtkostenquote	0,65%

HANDELSINFORMATION

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

XETRA Ticker

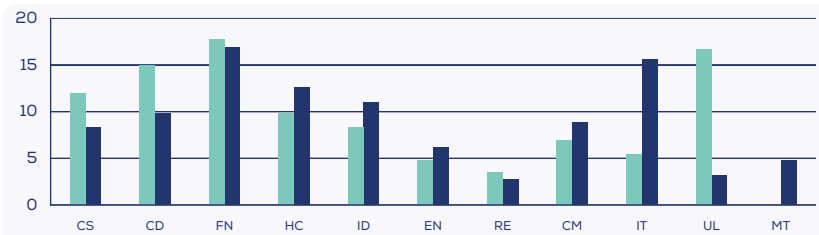
Bloomberg Ticker	OSXA GR
------------------	---------



REGIONALE ALLOKATION (28.02.2019)

Ossiam World Minimum Variance Index NR (USD)
S&P Global 1200 Index NR (USD)
Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Berechnung durch Ossiam

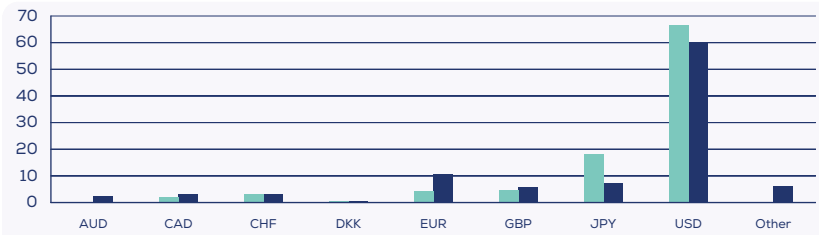
AU: Australia • CA: Canada • CH: Switzerland • DE: Germany • DK: Denmark • ES: Spain • FR: France • GB: United Kingdom • IE: Ireland • JP: Japan • NL: Netherlands • US: United States



SEKTOR ALLOKATION (28.02.2019)

Ossiam World Minimum Variance Index NR (USD)
S&P Global 1200 Index 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 World Minimum Variance Index NR (USD)
S&P Global 1200 Index NR (USD)
Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Berechnung durch Ossiam

AUD: Australian Dollar • CAD: Canadian Dollar • CHF: Swiss Franc • DKK: Danish krone • EUR: Euro • GBP: British Pound • JPY: Japanese Yen • USD: US Dollar

TOP 10 POSITIONEN (%) 28.02.2019

	Ossiam World Minimum Variance Index NR	S&P Global 1200 Index NR
SOUTHERN CO/THE	3,21	0,13
CME GROUP INC	2,87	0,17
NISSAN MOTOR CO LTD	2,57	0,05
NEXTERA ENERGY INC	2,52	0,23
ASTELLAS PHARMA INC	2,50	0,08
MCDONALD'S CORP	2,30	0,36
DUKE ENERGY CORP	2,09	0,16
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,99	0,07
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,87	0,13
PUBLIC STORAGE	1,74	0,08

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 (Zulassungsnr. GP-10000016) zugelassen ist. Für die Vermarktung in Deutschland zugelassen.

OSSIAM WORLD 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 WORLD MINIMUM VARIANCE NR oder gegenüber einem Mitglied der Öffentlichkeit keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Zusicherung oder Gewährleistung bezüglich der Zweckmäßigkeit, in Wertpapiere im Allgemeinen oder in den OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR im Besonderen zu investieren, oder bezüglich der Eignung des Ossiam World Minimum Variance Index Net Return (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 WORLD MINIMUM VARIANCE NR oder die Bestimmung des Zeitpunkts der Ausgabe oder des Verkaufs des OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR oder die Festlegung oder Berechnung der Gleichung, mit der der OSSIAM WORLD 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 WORLD MINIMUM VARIANCE NR. S&P, seine verbundenen Unternehmen und deren externe Lizenzgeber übernehmen keine Garantie für die Eignung, Genauigkeit, Aktualität oder Vollständigkeit des Index, der darin enthaltenen Daten oder diesbezüglicher Mitteilungen jeglicher Art, einschliesslich mündlicher oder schriftlicher Mitteilungen (einschliesslich elektronisch übermittelter Mitteilungen). S&P, seine verbundenen Unternehmen und deren externe Lizenzgeber haften nicht für darin enthaltene Fehler, Auslassungen oder Verzögerungen. S&P gibt im Hinblick auf seine Warenzeichen, den Index oder jegliche darin enthaltene Daten keine ausdrückliche oder stillschweigende Zusicherung für die Markttauglichkeit oder betreffend der Eignung für einen bestimmten Zweck oder eine bestimmte Verwendung ab und lehnt ausdrücklich jegliche diesbezüglichen Gewährleistungen ab. Ohne Einschränkung des Vorstehenden haften S&P, seine verbundenen Unternehmen oder deren Lizenzgeber 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 sie von der Möglichkeit solcher Schäden in Kenntnis gesetzt worden sein sollten.

Standard & Poor's® und S&P® sind eingetragene Warenzeichen von Standard & Poor's Financial Services LLC. „Calculated by S&P Custom Indices“ und die damit verbundene stilisierte Marke sind Dienstleistungsmarken von Standard & Poor's Financial Services LLC und wurden für die Verwendung durch Ossiam lizenziert.

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.

