

Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector TR UCITS ETF 1A (EUR)

BESCHREIBUNG DER STRATEGIE

Die Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector Strategy ist darauf ausgerichtet, ein mit dem Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Index vergleichbares Risiko- und Ertragsprofil zu erzielen, allerdings bei deutlich geringerem CO2-Ausstoß und einem besseren ESG-Profil.

Die Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Strategy verfolgt einen systematischen Value-Ansatz und stützt sich dabei auf die Erkenntnisse von Professor Robert Shiller. Die Strategie ermöglicht ein Exposure in Bezug auf US-Aktien. Dabei wird ein auf dem konjunkturbereinigten Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) (CAPE®) basierendes Verfahren für die Sektorauswahl eingesetzt, um potenziell unterbewertete Sektoren zu ermitteln. Die Strategie soll eine Anlagemöglichkeit mit Value-Bias am Markt für Large Cap-Titel bieten und eignet sich für Buy-and-Hold-Anleger mit mehrjährigem Anlagehorizont.

Verbessertes ESG-Profil: Im Rahmen der Strategie werden Unternehmen aussortiert, die im Bereich umstrittener Waffen, Tabak und Kohle tätig sind oder in Bezug auf Umweltfragen, soziale Aspekte und Governance kontrovers diskutiert werden.

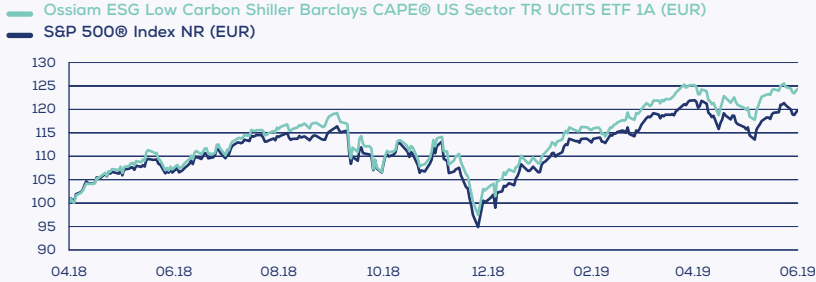
Verbesserung des CO2-Fußabdrucks: Im Vergleich zum ursprünglichen Index strebt die Strategie eine Reduzierung der Gesamtreibhausgasemissionen, der Kohlenstoffintensität (Emissionen im Verhältnis zu den Unternehmensumsätzen) sowie der Treibhausgasemissionen aus fossilen Reserven um 40 Prozent an.

Wichtigste Vorteile:

- Exposure in Bezug auf US-Aktien durch Anwendung eines auf der CAPE®-Kennzahl basierenden Verfahrens für die Sektorauswahl
- Auf Grundlage der Erkenntnisse von Professor Shiller entwickelte und häufig genutzte Bewertungsgröße
- Anlageprozess zur Identifizierung von auf lange Sicht potenziell unterbewerteten Sektoren
- Ansatz, der die Anwendung von ESG-Kriterien mit Zielen hinsichtlich der Reduzierung von Treibhausgasemissionen vereint

WERTENTWICKLUNG DES PRODUKTS SEIT AUFLEGUNG

28.06.2019



Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by Ossiam

WERTENTWICKLUNG
28.06.2019

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflegung annualisiert %
Fonds	4,99	19,94	15,38	–	–	19,93
Investment Universum	4,70	18,63	11,67	13,51	14,05	16,52

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by Ossiam

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR
28.06.2019

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	15,96	3,36	1,00	0,10	1,25	-18,25
Investment Universum	15,49	–	–	–	1,07	-18,49

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by 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: Bitte beachten Sie, dass der Fonds neben dem allgemeinen Marktrisiko auch spezifischen Risiken wie Währungs- und ESG-Risiken sowie geografischer Konzentration ausgesetzt ist. 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)



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.

INVESTMENT UNIVERSUM DATEN

Name	S&P 500® Index NR(EUR)
Bloomberg Ticker	SPTR500N Index
Auflegedatum	31.12.1998
Anlageklasse	Aktie
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

FONDSDATEN

Depotbank	BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited
Rechtsform	Sub fund of Ossiam IRL ICAV
Kategorie	Actively Managed ETF
UCITS	Ja
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	USD 49.707.925
Anlagevolumen der Anteilklasse	EUR 25.215.962
Nettoinventarwert	EUR 64,856
Anzahl der Anteile	388.800
Fondswährung	USD
Währung der Anteilklasse	EUR
ISIN	IE00BF92LV92
Auflegedatum	05.04.2018
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Gesamtkostenquote	0,75%

HANDELSINFORMATION

Cut-off	15.00 Uhr (irische Zeit) an jedem Handelstag
Mindestinvestment (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil
XETRA Ticker	
Bloomberg Ticker	SHEE GY

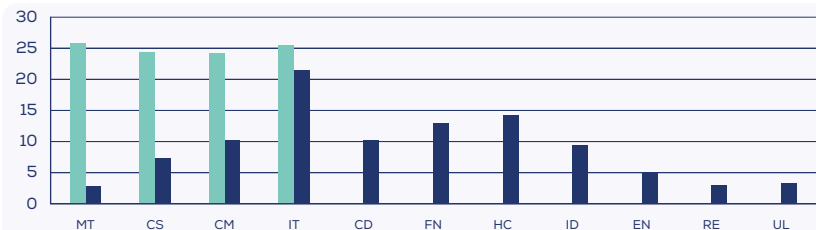
TOP 10 POSITIONEN (%)
28.06.2019

	Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector TR UCITS ETF	S&P 500® Index NR
APPLE INC	4,68	3,54
LINDE PLC	4,62	0,45
MICROSOFT CORP	4,50	4,20
WALT DISNEY CO/THE	4,46	1,00
PROCTER & GAMBLE CO/THE	4,39	1,13
PEPSICO INC	4,30	0,75
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,24	0,97
ECOLAB INC	3,76	0,21
AT&T INC	3,25	1,00
COCA-COLA CO/THE	3,23	0,80

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by 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



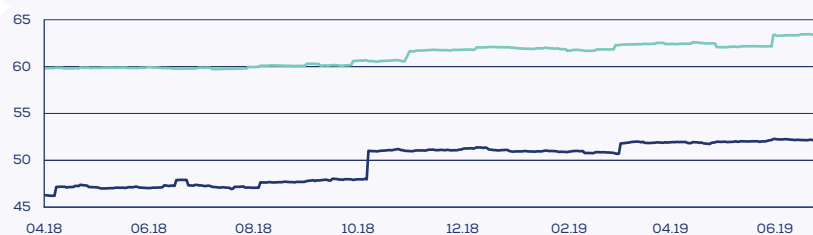
SEKTOR ALLOKATION
(28.06.2019)

■ Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector TR UCITS ETF 1A (EUR)
■ S&P 500® Index NR (EUR)
Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by Ossiam

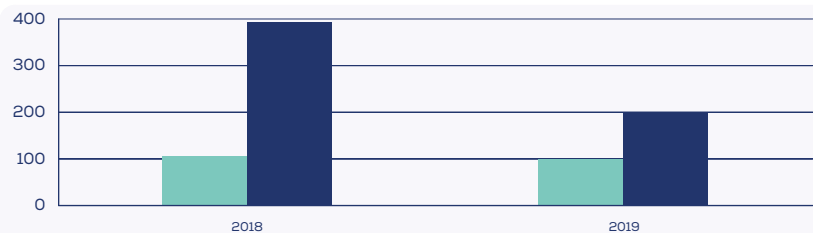
MT : Materials • CS : Consumer Staples • CD : Consumer Discretionary • FN : Financials • HC : Health Care • ID : Industrials • EN : Energy • RE : Real Estate • CM : Communications Services • IT : Information Technology • UL : Utilities

ESG-SCORES

— Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector TR UCITS ETF 1A (EUR)
— S&P 500® Index NR (EUR)



Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by Ossiam



TREIBHAUSGAS-EMISSIONEN In Tonnen CO2
(28.06.2019)

■ Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector TR UCITS ETF 1A (EUR)
■ S&P 500® Index NR (EUR)
Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by Ossiam

Dieses Dokument hat einen wirtschaftlichen und keinen regulatorischen Hintergrund.

Ossiam IRL ICAV ("ICAV") ist ein Umbrella-Fonds, der nach irischem Recht als offene Investmentgesellschaft mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds gegründet wurde und von der Central Bank of Ireland unter der Nummer C173953 zugelassen wurde. ICAV hat Ossiam zu seiner Verwaltungsgesellschaft ernannt, die für das Finanzmanagement der Fonds sowie für die Verwaltung und den Vertrieb von ICAV verantwortlich ist. Ossiam, eine Tochtergesellschaft von Natixis Investment Managers, ist von der Autorité des Marchés Financiers als Portfolio Management Company unter der Nummer GP-10000016 zugelassen. Für die Vermarktung in Deutschland zugelassen. Die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Angemessenheit von Informationen aus externen Quellen ist nicht gewährleistet, obwohl sie aus zuverlässigen, seriösen Quellen zusammengestellt wurde. Der Zugang zu den in diesem Dokument beschriebenen Produkten und Dienstleistungen kann Einschränkungen für bestimmte Personen oder in bestimmten Ländern unterliegen. Keines der hier vorgestellten Produkte oder Dienstleistungen wird von Ossiam zur Verfügung gestellt.