

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

INVESTMENTSTRATEGIE

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.

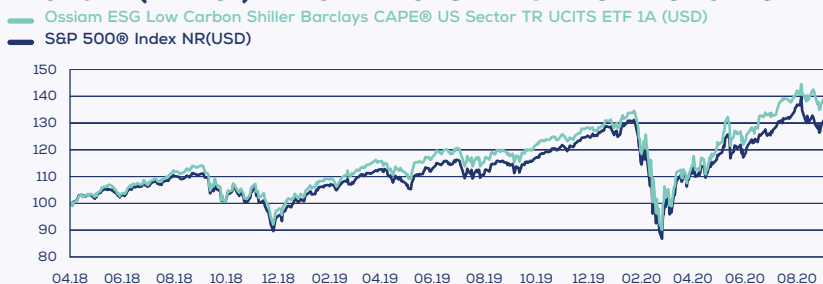
Verbessertes ESG-Profil: Im Rahmen der Strategie werden Unternehmen aussortiert, die im Bereich umstrittener Waffen, Tabak und Kohle tätig sind oder in Bezug auf Umweltfragen, soziale Aspekte und Governance kontrovers diskutiert werden.

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

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflegung annualisiert %
Fonds	-1,30	8,32	17,14	-	-	13,81
Investment Universum	-3,84	5,13	14,49	11,60	13,44	11,34

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLEGEUNG DES FONDS

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	Sharpe ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	24,77	2,47	1,00	0,49	-33,04
Investment Universum	24,26	-	-	0,40	-33,83

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

WICHTIGE INFORMATIONEN: Die Angaben zur Wertentwicklung verstehen sich abzüglich der Gebühren. Der Wert einer Investition und die daraus resultierenden Einnahmen können variieren und der anfängliche Investitionsbetrag kann nicht garantiert werden. ETFs werden wie Aktien an den Börsen gehandelt und die Handelspreise können vom Nettoinventarwert des ETFs abweichen. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Risikohinweise: Bitte beachten Sie, dass der Fonds neben dem allgemeinen Marktrisiko auch spezifischen Risiken wie Risiken im Zusammenhang mit ESG-Investments sowie geografischer Konzentration ausgesetzt ist. Um mehr über die Risiken zu erfahren, lesen Sie bitte die Wesentlichen Anlegerinformation (KIID) und den Verkaufsprospekt vor einer Investition.

Bitte beachten Sie, dass im Fall eines Währungsunterschiedes zwischen der Währung des Fonds-/der Anlageklasse und Ihrer Heimatwährung, Gewinne oder Verluste des Fonds/der Anlageklasse durch Wechselkursschwankungen (sowohl nach oben als auch unten) beeinflusst werden können.

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR (SRRI)



Der SRRI steht für das Risiko- und Renditeprofil, wie auch in der Wesentlichen Anlegerinformation dargestellt 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(USD)
Bloomberg Ticker	SPTR500N Index
Auflegedatum	31.12.1998
Anlageklasse	Aktien
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

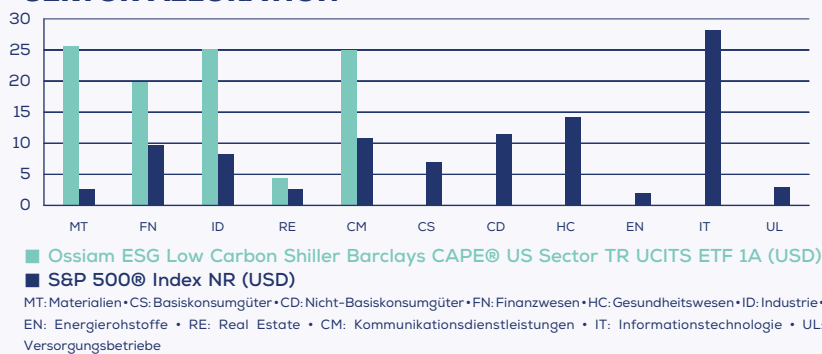
FONDSDATEN

Depotbank	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Rechtsform	Sub fund of Ossiam IRL ICAV
Kategorie	Actively Managed ETF
UCITS	Ja
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	USD 227.768.260
Anlagevolumen der Anteilklasse	USD 108.176.776
Nettoinventarwert	USD 87.521
Anzahl der Anteile	1.236.006
Fondswährung	USD
Währung der Anteilklasse	USD
ISIN	IE00BF92LR56
Auflegedatum	05.04.2018
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0,75%

HANDELSINFORMATION

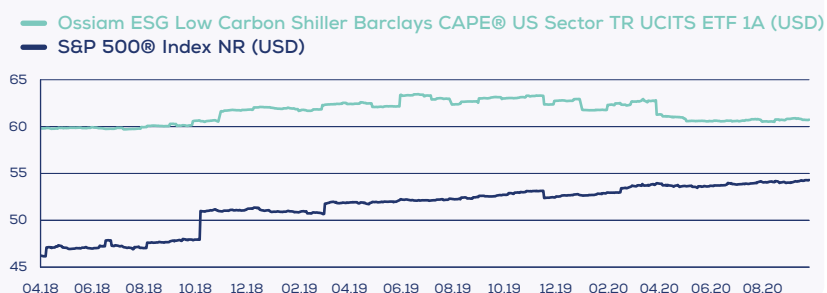
Annahmeschluss	15.00 Uhr (irische Zeit) an jedem Handelstag
Mindestanlagesumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil
Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten	
London Stock Exchange in USD	5HED LN
London Stock Exchange in GBP	5SHEP LN
XETRA in USD	5HED GY

SEKTOR ALLOKATION



Von Ossiäm berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiäm, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

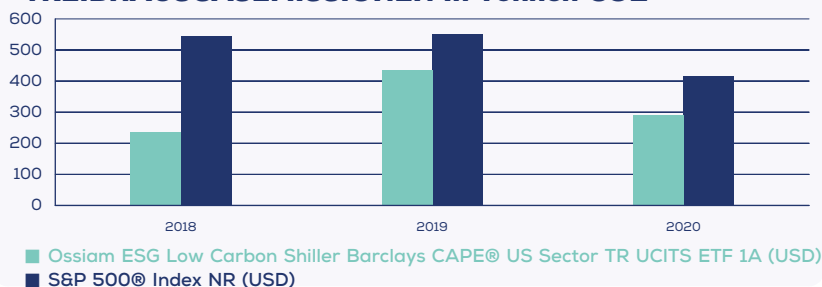
ESG-SCORES*



Von Ossiäm berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiäm, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

*Der ESG-Score ist ein gewichteter Durchschnitt des ESG-Scores eines jeden einzelnen Komponenten des Index.

TREIBHAUSGASEMISSIONEN In Tonnen CO2**



Von Ossiäm berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiäm, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

**THG-Emissionen (Treibhausgase) geben die Emissionen in CO₂-Tonnen an und entsprechen einem Investment in Höhe von 1 Mio. USD im Index.

TOP 10 POSITIONEN (%)

	Ossiäm ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector TR UCITS ETF	S&P 500® Index NR
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,64	0,88
LINDE PLC	4,34	0,45
NETFLIX INC	4,13	0,79
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,28	0,20
WALT DISNEY CO/THE	3,10	0,80
ECOLAB INC	2,91	0,18
TWITTER INC	2,66	0,13
AMETEK INC	2,60	0,08
NEWMONT MINING CORP	2,53	0,18
S&P GLOBAL INC	2,30	0,31

Von Ossiäm berechnete Daten zum 30.09.2020. Quelle: Ossiäm, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

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.

Ossiäm 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 Ossiäm zu seiner Verwaltungsgesellschaft ernannt, die für das Finanzmanagement der Fonds sowie für die Verwaltung und den Vertrieb von ICAV verantwortlich ist. Ossiäm, eine Tochtergesellschaft von Natix 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 Ossiäm zur Verfügung gestellt.

Dieses Dokument wurde zu Informationszwecken ausschließlich Finanzdienstleistern oder anderen professionellen Kunden oder qualifizierten Investoren und, soweit aufgrund lokaler Bestimmungen erforderlich, nur auf deren schriftlicher Anfrage zur Verfügung gestellt. Dieses Material ist nicht für Privatanleger bestimmt. Es liegt in der Verantwortung eines jeden Finanzdienstleisters sicherzustellen, dass das Angebot oder der Verkauf von Fondsanteilen oder Wertpapierdienstleistungen Dritter an seine Kunden im Einklang mit den jeweiligen nationalen Gesetzen steht.

In Deutschland und Österreich: Dieses Dokument wird von Natixis Investment Managers S.A. oder ihrer Zweigniederlassung Natixis Investment Managers S.A., Zweigniederlassung Deutschland, bereitgestellt. Natixis Investment Managers S.A. ist eine Luxemburger Verwaltungsgesellschaft, die von der Commission de Surveillance du Secteur Financier zugelassen wurde und die nach dem Recht des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und unter Registernummer B 115843 registriert ist. Eingetragener Sitz von Natixis Investment Managers S.A. ist 2 rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg. Eingetragener Sitz von Natixis Investment Managers S.A., Zweigniederlassung Deutschland (Handelsregisternummer: HRB 88541) ist: Im Trutz Frankfurt 55, Westend Carrée, 7. Etage, Frankfurt am Main 60322, Deutschland.

In der Schweiz: Dieses Dokument wird von Natixis Investment Managers, Switzerland Sàrl, Rue du Vieux Collège 10, 1204 Genf, Schweiz, oder dessen Repräsentanz in Zürich, Schweizergasse 6, 8001 Zürich, ausschliesslich zu Informationszwecken herausgegeben.

Die oben erwähnte Gesellschaft ist eine Geschäftsentwicklungseinheit von Natixis Investment Managers, einer Holdinggesellschaft mit einem breit gefächerten Angebot spezialisierter Vermögensverwaltungseinheiten und Distributionsgesellschaften weltweit. Die Vermögensverwaltungstochtergesellschaften der Natixis Investment Managers führen regulierte Tätigkeiten nur in und von Jurisdiktionen aus/durch, in denen sie hierzu lizenziert oder autorisiert sind. Ihre Dienstleistungen und die Produkte, die sie verwalten, sind nicht allen Investoren in allen Jurisdiktionen zugänglich.

Obwohl Natixis Investment Managers die in diesem Dokument bereitgestellten Informationen, einschließlich der Informationen aus Drittquellen, für vertrauenswürdig hält, kann die Richtigkeit, Angemessenheit oder Vollständigkeit dieser Informationen nicht garantiert werden.

Die Bereitstellung dieses Dokuments und/oder Bezugnahmen auf bestimmte Wertpapiere, Sektoren oder Märkte in diesem Dokument stellen keine Anlageberatung oder eine Anlageempfehlung oder ein Angebot, Wertpapiere zu erwerben oder zu veräußern, oder ein Angebot von Dienstleistungen dar. Investoren sollten Anlageziele, Risiken und Kosten einer jeden Investition zuvor sorgfältig prüfen. Die Analysen, Meinungen und bestimmte Anlagethemen und Verfahren, auf die in diesem Dokument verwiesen wird, geben die Ansichten des Portfoliomanagers zum angegebenen Datum wieder. Sowohl diese als auch die dargestellten Portfoliobestände und Portfolioeigenschaften unterliegen einer stetigen Veränderung. Es kann keine Zusicherung gegeben werden, dass Entwicklungen in der Form eintreten, wie sie in diesem Dokument gegebenenfalls prognostiziert wurden. Dieses Dokument darf nicht, auch nicht teilweise, verbreitet, veröffentlicht oder reproduziert werden.

Alle Beträge in diesem Dokument sind in USD ausgewiesen, sofern nichts anderes angegeben ist.