

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

OSSIAM SOLACTIVE MOODY'S ANALYTICS IG EUR Select Credit (UCITS ETF 1C(EUR)ISIN:LU1093307442), ein Teilfonds der OSSIAM LUX SICAV

Verwaltungsgesellschaft: Ossiam, eine Gesellschaft der Natixis-Gruppe

Ziele und Anlagepolitik

Anlageziel

Das Anlageziel des OSSIAM SOLACTIVE MOODY'S ANALYTICS IG EUR Select Credit (der „Fonds“) ist die Nachbildung der Wertentwicklung des SOLACTIVE MOODY'S ANALYTICS IG EUR Select Credit Index auf Basis des Indexschlusskurses und vor Abzug der Gebühren und Aufwendungen des Fonds.

Der SOLACTIVE MOODY'S ANALYTICS IG EUR Select Credit Index (der „Index“) ist ein in EUR ausgedrückter Gesamtrendite-Index (mit Wiederanlage des Nettoertrags an jedem Neugewichtungstag), der von Solactive (der „Index-Anbieter“) erstellt wurde und von Solactive berechnet und veröffentlicht wird.

Der SOLACTIVE MOODY'S ANALYTICS IG EUR Select Credit Index ist ein regelbasierter Index, der auf eine Maximierung der Gesamtrendite einer angemessen liquiden und diversifizierten Auswahl von Anleihen unter Beibehaltung eines niedrigen Kreditrisiko-Profiles abzielt. Der Index spiegelt die Gesamtrendite-Performance einer Auswahl von 100 Anleihen unter den umfangreichsten Unternehmensanleihen-Emissionen (umlaufender Betrag über 750 Mio. EUR) aus dem Solactive Euro IG Corporate Index (der „Basisindex“) wider, der die Performance von auf EUR lautenden Festzins-Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating nachbildet. Für die Einstufung als „Investment Grade“ ist ein Mindestrating von BBB- durch Standard & Poor's oder von Baa3 durch Moody's erforderlich. Vorsorglich wird darauf hingewiesen, dass die Anleihe im Falle ihrer Einstufung als „Investment Grade“ nur durch eine der Rating-Agenturen in den Index aufgenommen werden kann.

Jeder Bestandteil erhält an jedem Neugewichtungstag dieselbe Gewichtung (1 % unter normalen Umständen). Daher weichen das Sektor-, Unternehmens- und Länderengagement des Index wahrscheinlich von jenen des Basisindex ab. Der Index wird vierteljährlich neu zusammengestellt.

Eine ausführliche Beschreibung des Index finden Sie im Abschnitt „Beschreibung des Index“ im jeweiligen Fondsanhang des Prospekts.

Anlagepolitik

Um sein Anlageziel zu erreichen, verwendet der Fonds in erster Linie Swaps, die ihm durch synthetische Replikation die Nachbildung der Indexperformance ermöglichen sollen.

In diesem Fall investiert der Fonds in ein Vermögensportfolio, dessen Performance gegen die Performance des Index oder eines verbundenen Index oder eines Portfolios seiner

Bestandteile mittels einer Swap-Vereinbarung mit einem Swap-Kontrahenten getauscht wird.

Diese Methode ist mit einem Kontrahentenrisiko verbunden, das nachstehend im Risiko- und Ertragsprofil näher beschrieben wird. Der Nettoinventarwert pro Anteil des Fonds steigt (oder fällt) somit entsprechend der Entwicklung des Index.

Der Kontrahent des Swaps ist ein erstklassiges Finanzinstitut, das auf diese Art von Transaktionen spezialisiert ist. Der Fonds kann auch mehrere Swap-Vereinbarungen mit mehreren Swap-Kontrahenten abschließen, die ebenfalls die vorstehend beschriebenen Merkmale aufweisen.

Unter gebührender Beachtung der Interessen seiner Anteilhaber kann der Fonds auch beschließen, die vorstehend beschriebene synthetische Nachbildung vollständig oder teilweise durch physische Nachbildung zu ersetzen.

Bei beiden Nachbildungsstrategien muss der Fonds dauerhaft in auf EUR lautenden Anleihen mit Investment-Grade-Rating investiert sein.

Der Fonds darf ergänzend in Geldmarktinstrumente investieren oder andere Derivate für Hedging- und Anlagezwecke einsetzen und Wertpapierleih- und Pensionsgeschäfte sowie Repo-Geschäfte tätigen. Diese Transaktionen sind unter „Einsatz von Derivaten sowie besonderer Anlage- und Sicherungstechniken (Hedging)“ im Prospekt beschrieben.

Die Referenzwährung des Fonds ist der Euro.

Die Anteile der Anteilklasse UCITS ETF 1C(EUR) sind an einer oder mehreren Börsen zum Handel zugelassen. Anleger können die Anteile an einem beliebigen Handelstag der maßgeblichen Börse(n), der gleichzeitig ein Handelstag in Luxemburg ist, durch ihren üblichen Broker oder über eine Fondsplattform kaufen oder verkaufen. Wenn Sie weitere Informationen wünschen, wenden Sie sich bitte an Ihren Broker. Die Anteilklasse UCITS ETF 1C(EUR) ist eine thesaurierende Anteilklasse, d. h. aus dem Fonds erzielte Erträge werden reinvestiert. Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Zeichnung, Übertragung, Umtausch und Rücknahme von Fondsanteilen“ und dem Abschnitt „Praktische Informationen“ des Fondsanhangs im Prospekt.

Empfehlung: Dieser Fonds ist unter Umständen nicht für Anleger geeignet, die ihr Geld innerhalb eines Zeitraums von drei Jahren aus dem Fonds wieder zurückziehen wollen.

Risiko- und Ertragsprofil

Geringeres Risiko

Höheres Risiko



| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|

Auf der Skala des synthetischen Risiko-Ertrags-Indikators erreicht der Fonds die Stufe 3. Dieser Indikator basiert auf historischen Daten. Aufgrund seines Engagements an den Rentenmärkten kann der Fonds eine mittlere Volatilität verzeichnen, was die auf der erwähnten Skala erreichte Stufe verdeutlicht. Historische Daten sind kein verlässlicher Hinweis auf das künftige Risikoprofil. Die angegebene Risikokategorie ist nicht garantiert und kann sich im Laufe der Zeit ändern. Für den Wert des Fonds besteht weder eine Kapitalgarantie noch ein Kapitalschutz. Die niedrigste Kategorie bedeutet nicht „risikofrei“.

Spezielle Risikoaspekte

Indexrisiko: Der Wert der Fondsanteile hängt von der Entwicklung des Index ab, dessen Wert fallen oder steigen kann. Die Anleger sollten sich daher bewusst sein, dass der Wert ihrer Anlage sowohl steigen als auch fallen kann. Sie sollten in Kauf nehmen, dass die dem Index zugrunde liegende Methode möglicherweise keine höheren Erträge zur Folge hat als vergleichbare Anlagestrategien und dass sie ihr ursprünglich investiertes Kapital unter Umständen nicht zurückerhalten.

Kreditrisiko: Aufgrund der Anlage in Schuldtiteln, die von Unternehmen, Banken oder staatlichen Organisationen begeben werden, unterliegt der Fonds möglicherweise dem Risiko, dass der Emittent nicht in der Lage ist, die vereinbarten Zahlungen (Kapital und Zinszahlungen) an die Inhaber der Schuldtitel zu leisten.

Derivate- und Kontrahentenrisiko: Durch den Abschluss von Wertpapierleihgeschäften sowie Pensionsgeschäften und Swap-Geschäften ist der Fonds möglichen Kontrahenten- oder Emittentenrisiken ausgesetzt. Bei Insolvenz oder Zahlungsausfall des Kontrahenten oder Emittenten könnte der Fonds Verluste erleiden.

Der Wert der Swap-Geschäfte hängt von mehreren Faktoren ab, wie zum Beispiel (jedoch nicht ausschließlich) vom Indexstand, dem Zinsniveau und der Liquidität des Aktienmarkts.

Risiken aus der Portfoliokonzentration: Fonds, die in eine begrenzte Zahl von Wertpapieren investieren, können höhere Schwankungen der Anlageperformance verzeichnen. Schneiden die Wertpapiere schlecht ab, sind die Verluste für den Fonds möglicherweise höher, als wenn er in eine größere Anzahl von Wertpapieren investiert hätte.

Weitere Einzelheiten zu den Risiken entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Allgemeine Risiken“ im Verkaufsprospekt.

Kosten

Die von Ihnen getragenen Kosten gewährleisten die Verwaltung des Fonds sowie dessen Vertrieb und Vermarktung. Diese Kosten reduzieren das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage.

Gebühren je Anteilsklasse – Anteilsklasse UCITS ETF 1C(EUR)

Einmalige Aufwendungen vor oder nach Ihrer Anlage

| | |
|---------------------------|---|
| Ausgabeaufschlag | Maximaler Ausgabeaufschlag 3,00 % Maximale Replikationsgebühr für Zeichnungen 1,00 % |
| Rücknahmeabschlag* | Maximale Rücknahmegebühr 3,00 % Maximale Replikationsgebühr für Rücknahmen 1,00 % |

Dies sind die Höchstbeträge, um die sich Ihre Anlagesumme reduzieren kann, bevor sie investiert wird bzw. bevor die Erlöse Ihrer Anlage an Sie ausgezahlt werden.

Jährliche Kosten zulasten des Fonds

| | |
|---|--------------|
| Laufende Kosten: | 0,35 % p. a. |
| Total Expense Ratio (Gesamtkostenquote) | |

Kosten, die dem Fonds unter bestimmten Bedingungen belastet werden

| | |
|---|-------|
| An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren: | Keine |
|---|-------|

Die **Ausgabeaufschläge** und **Rücknahmeaufschläge** sind Maximalangaben. Unter Umständen wird Ihnen weniger belastet. Ihr Finanzberater kann Ihnen weitere Informationen geben.

* Falls ein Anleger einen exzessiven Handel betreibt oder Market-Timing praktiziert, kann von ihm eine zusätzliche Gebühr von bis zu 2,00 % erhoben werden.

Die **laufenden Kosten** beziehen sich auf das am 31. Dezember 2017 abgelaufene Geschäftsjahr. Die Höhe dieser Kosten kann sich jährlich ändern. Nicht inbegriffen sind Transaktionskosten des Portfolios, außer wenn die SICAV für Erwerb oder Veräußerung von anderen Organismen für gemeinsame Anlagen Ausgabeaufschläge und Rücknahmeaufschläge bezahlen muss.

Weitere Informationen zu den Kosten können den Kapiteln „Gebühren und Aufwendungen“ und „Zeichnung, Übertragung, Umtausch und Rücknahme von Fondsanteilen“ im Prospekt des Fonds entnommen werden. Dieser ist über die Website www.ossiam.com abrufbar.

Wertentwicklung in der Vergangenheit

Es liegen nicht genügend Daten vor, um den Anlegern sinnvolle Informationen über die frühere Wertentwicklung dieses Fonds zu bieten.

Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Hinweis auf künftige Ergebnisse.

Datum der Fondserrichtung: 29. Dezember 2017

Datum der Auflegung der Anteilsklasse: 29. Dezember 2017

Praktische Informationen

Depot- und Hauptverwaltungsstelle des Fonds:

State Street Bank Luxembourg
49, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

Verwaltungsgesellschaft:

Ossiam
6, place de la Madeleine
75008 Paris, Frankreich

Handelsschluss: 15:45 Uhr (Luxemburger Zeit)

Der indikative Nettoinventarwert des Fonds wird in Echtzeit veröffentlicht. Angaben zum Portfolio des Fonds werden in den Jahres- und Halbjahresberichten des Fonds offengelegt.

Weitere Informationen über die SICAV und den Fonds können kostenlos am Geschäftssitz der Verwaltungsgesellschaft oder der Depot- und Hauptverwaltungsstelle angefordert werden. Hierzu zählen die englischen Fassungen des Verkaufsprospekts, der Berichte und Abschlüsse der gesamten SICAV sowie Informationen zum Verfahren für den Umtausch von Anteilen zwischen Teilfonds. Der Anteilspreis des Fonds ist über www.ossiam.com abrufbar und kann auch am Geschäftssitz der Verwaltungsgesellschaft oder der Hauptverwaltungsstelle angefordert werden.

Einzelheiten zur aktuellen Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft, einschließlich einer Beschreibung der Art und Weise, wie Vergütungs- und Zusatzleistungen berechnet und gewährt werden, sind über die folgende Website abrufbar: www.ossiam.com. Ein gedrucktes Exemplar ist außerdem auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eines jeden Teilfonds sind rechtlich voneinander getrennt. Die Rechte der Anleger und Gläubiger bezüglich eines Teilfonds sind daher auf die Vermögenswerte dieses Teilfonds begrenzt, sofern die Gründungsunterlagen der SICAV nichts anderes vorsehen.

Der Fonds unterliegt in Luxemburg unter Umständen einer speziellen steuerlichen Behandlung. Je nach Ihrem Wohnsitzland könnte sich dies auf Ihre Anlage auswirken. Wenn Sie weitere Informationen wünschen, wenden Sie sich bitte an einen Berater.

Weitere Informationen

| Anteilsklasse | ISIN | Art der Anleger | Währung | Mindestzeichnungserfordernis | Mindestrücknahmeerfordernis | Ausschüttungspolitik | TER |
|--------------------|--------------|-----------------|---------|------------------------------|-----------------------------|----------------------|--------|
| UCITS ETF 1C (EUR) | LU1093307442 | Alle Anleger* | Euro | 1.000.000 EUR | 1.000.000 EUR | Thesaurierend | 0,35 % |

* Zeichnungen am Primärmarkt nur für autorisierte Teilnehmer und zugelassene Anleger.

Ossiam kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Fondsprospekts vereinbar ist.

Dieser Fonds ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier reguliert.

Ossiam ist in Frankreich zugelassen und unterliegt der Aufsicht der Autorité des Marchés Financiers (AMF).

Diese wesentlichen Anlegerinformationen sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 31. Juli 2018.