

Stand: 31.08.2023

Ossiam US ESG Low Carbon Equity Factors UCITS ETF - 1A (EUR)

INVESTMENTSTRATEGIE

Der Ossiam US ESG Low Carbon Equity Factors UCITS ETF zielt darauf ab, die Netto-Gesamtrendite einer Auswahl von börsennotierten US-Aktien nachzubilden, welche auf Basis ihrer ESG-Merkmale (Environment, Social, Governance) und ihres Exposures gegenüber Aktienfaktoren (Momentum, Size, Value und Volatility) bewertet werden.

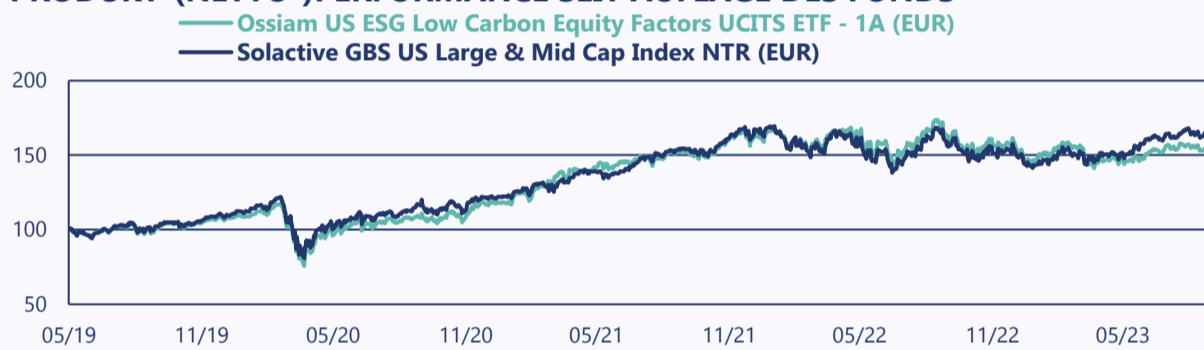
Der Anlageprozess des Fonds ist systematisch. Zuerst werden 80% der nach ESG-Kriterien am besten bewerteten Aktien ausgewählt, die dann wiederum gefiltert werden, um Unternehmen auszuschließen, die gegen einen vordefinierten Kriterienkatalog verstoßen.

Aus dem Aktienpool werden dann zwei unterschiedliche Portfolios gebildet, die im finalen Portfolio letztlich gleich gewichtet werden: ein Aktienfaktor-Portfolio und ein Sektorfaktor-Portfolio. Lediglich Aktien mit dem höchsten Exposure gegenüber den oben genannten Faktoren gelangen in das Aktienfaktor-Portfolio und werden entsprechend ihres Exposure gegenüber diesen Faktoren gewichtet, während gleichzeitig ein CO₂-Fußabdruck von unter 40% im Vergleich zur Benchmark angestrebt wird. Für das Sektorfaktor-Portfolio berücksichtigt die Strategie nur Value- und Momentum-Faktoren. Die Gewichtungen der Sektoren werden entsprechend der Signifikanz ihres Exposure gegenüber beiden Faktoren im Vergleich zur Benchmark nach oben oder unten angepasst. Die Aktien im Sektorfaktor-Portfolio werden ebenfalls gewichtet, um den CO₂-Fußabdruck des finalen Portfolios um 40% gegenüber der Benchmark zu reduzieren.

Wichtigste Vorteile:

- Exposure in Bezug auf eine Auswahl von US-Aktien
- Nutzung etablierter Aktienfaktoren, um beständige, nachhaltige und langfristige performance bei kontrolliertem Tracking Error zu erzielen
- Anwendung einer dynamischen Gewichtungsmethode basierend auf vier Faktoren (Momentum, Size, Value und Volatility)
- Verbesserung des ESG-Profiles mit deutlicher Reduzierung der CO₂-Bilanz

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS



Von Ossiam berechnete Daten zum 31.08.2023. Quelle: Ossiam, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre ann. %	5 Jahre ann. %	Seit Auflage ann. %
Fonds	-0,76	6,71	-3,27	13,04	---	10,78
Investment Universum	-0,12	17,29	7,11	12,94	---	12,66

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.08.2023. Quelle: Ossiam, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität Ann. %	Apha Ann. %	Beta	Sharpe Ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	22,35	-1,09	0,94	0,48	-35,56
Investment Universum	22,88	---	---	0,55	-33,77

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.08.2023. Quelle: Ossiam, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

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 frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.**

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 (KID) und den Verkaufsprospekt vor einer Investition. Der Referenzwert soll nicht mit den ökologischen oder sozialen Ambitionen des Fonds in Einklang gebracht werden. Dieser Fonds fördert ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG), hat jedoch nicht das Ziel, nachhaltige Investitionen zu tätigen. Er kann teilweise in Vermögenswerte investieren, die ein nachhaltiges Ziel verfolgen, wie es beispielsweise in der EU-Klassifikation definiert ist. Diese in EUR denominierte Anteilsklasse ist nicht gegen Währungsschwankungen abgesichert.

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.

AUSSCHLIESSLICH FÜR IN DEN FONDS INVESTIERTE PROFESSIONELLE INVESTOREN ODER PRIVATANLEGER.

BITTE LESEN SIE DEN PROSPEKT UND DAS KID, BEVOR SIE EINE ENDGÜLTIGE ANLAGEENTSCHEIDUNG TREFFEN.

RISIKOINDIKATOR



Die Anteilsklasse ist auf der synthetischen Risikoindikatorkala, die auf historischen Daten basiert, in die Kategorie 5 eingestuft. Aufgrund seines Engagements an den Aktienmärkten kann der Fonds eine erhebliche Volatilität verzeichnen, was sich in der Einstufung auf der obigen Skala niederschlagen hat. Daten aus der Vergangenheit sind möglicherweise kein zuverlässiger Hinweis auf die Zukunft. Die angegebene Risikokategorie ist nicht garantiert und kann sich im Laufe der Zeit ändern. Es besteht keine Kapitalgarantie und kein Schutz in Bezug auf den Wert des Fonds. Die niedrigste Kategorie bedeutet nicht, dass die Anlage risikofrei ist. Sie könnten Ihre Investition ganz oder teilweise verlieren.

INVESTMENT UNIVERSUM DATEN

Name	Solactive GBS US Large & Mid Cap Index NTR (USD)
Bloomberg Ticker	SUSLMCN Index
Auflagedatum	08.05.2017
Anlageklasse	Aktien
Häufigkeit der Neugewichtung	Quartalsweise

FONDSDATEN

Depotbank	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Rechtsform	Teilfonds des Ossiam IRL ICAV
UCITS	Ja
Classification SFDR	Article 8
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	USD 154 056 598
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 5 287 502
Nettoinventarwert	EUR 155.863
Anzahl der Anteile	33 924
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	IE00BJBLDK52
Auflagedatum	02.05.2019
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0.45%

HANDELSINFORMATION

Annahmeschluss 15.00 Uhr (irische Zeit)

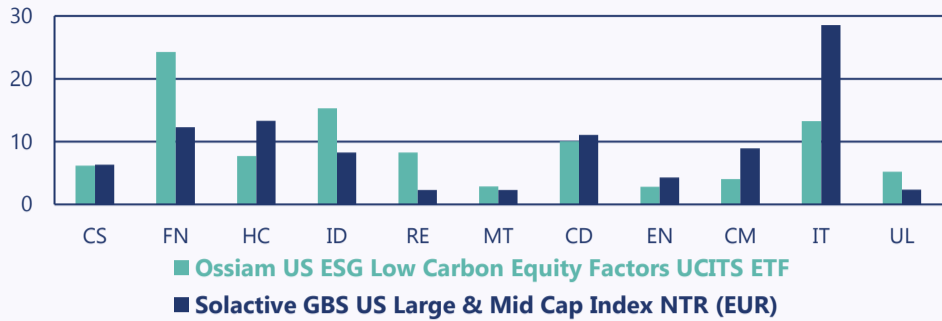
Mindestanlagesumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse) 1 Anteil

Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten

XETRA in EUR OUFE GY

Borsa Italiana in EUR OUFE IM

SEKTOR ALLOKATION



MT: Materialien • CS: Basiskonsumgüter • CD: Nicht-Basiskonsumgüter • FN: Finanzwesen • HC: Gesundheitswesen • ID: Industrie • EN: Energierohstoffe • RE: Real Estate • CM: Kommunikationsdienstleistungen • IT: Informationstechnologie • UL: Versorgungsbetriebe

Von Ossia berechnete Daten zum 31.08.2023. Quelle: Ossia, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

TOP 10 POSITIONEN

	Ossia US ESG Low Carbon Equity Factors UCITS ETF	Solactive GBS US Large & Mid Cap Index NTR
JPMORGAN CHASE & CO	2.61%	1.12%
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1.30%	0.04%
COMCAST CORP-CLASS A	1.29%	0.51%
F5 NETWORKS INC	1.24%	---
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1.18%	0.05%
EDISON INTERNATIONAL	1.16%	0.07%
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	1.12%	0.06%
GEN DIGITAL INC	1.11%	0.03%
NETAPP INC	1.10%	0.04%
AMDOCS LTD	1.10%	0.03%

Von Ossia berechnete Daten zum 31.08.2023. Quelle: Ossia, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

KONTAKT / INFO

www.ossiam.com
 mail: info@ossiam.com
 Tel: +33 1 84 79 42 70
 36 rue Brunel
 75017 PARIS - FRANCE

Dieses Dokument hat einen wirtschaftlichen und keinen regulatorischen Hintergrund.

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

ESG-Investitionen - Methodische Grenzen : Mit der Verwendung von GSR-Kriterien in der Investitionspolitik verfolgt der betreffende Fonds insbesondere das Ziel, das Nachhaltigkeitsrisiko besser zu steuern. Die ESG-Kriterien können mit Hilfe proprietärer Modelle, Modelle und Daten Dritter oder einer Kombination aus beiden generiert werden. Die Bewertungskriterien können sich im Laufe der Zeit ändern oder je nach Sektor oder Branche, in der der betreffende Emittent tätig ist, variieren. Die Anwendung von GSS-Kriterien auf den Anlageprozess kann dazu führen, dass der Finanzmanager Wertpapiere aus nichtfinanziellen Gründen unabhängig von den verfügbaren Marktchancen anlagert oder ausschließt. Die von Dritten erhaltenen ESG-Daten können unvollständig, unrichtig oder von Zeit zu Zeit nicht verfügbar sein. Daher besteht die Gefahr, dass der AIFM ein Wertpapier oder einen Emittenten falsch bewertet, was zur Einbeziehung oder zum direkten oder indirekten Ausschluss eines Wertpapiers aus dem Portfolio eines Fonds führt.

Nachhaltigkeitsrisiko :Der Fonds unterliegt Nachhaltigkeitsrisiken im Sinne von Artikel 2(22) der Verordnung (EU) 2019/2088 durch ein Ereignis oder eine Situation in den Bereichen Umwelt, Soziales oder Governance, das bzw. die, falls es dazu kommt, erhebliche negative Auswirkungen haben könnte; tatsächlichen oder potenziellen Wert der Investition. Weitere Informationen zum Mainstreaming-Konzept für Nachhaltigkeitsrisiken finden Sie auf der Website der Verwaltungsgesellschaft und des Finanzleiters.

Die Abstimmungs- und Einsatzstrategie ist unter folgendem Link abrufbar: www.ossiam.com

Das KID in deutscher Sprache, sowie der Prospekt in englischer, sind kostenlos auf unserer Website verfügbar www.ossiam.com

AUSSCHLIESSLICH FÜR IN DEN FONDS INVESTIERTE PROFESSIONELLE INVESTOREN ODER PRIVATANLEGER.
 BITTE LESEN SIE DEN PROSPEKT UND DAS KID, BEVOR SIE EINE ENDGÜLTIGE ANLAGEENTSCHEIDUNG TREFFEN.

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.

Einen Überblick über die Anlegerrechte in der Amtssprache Ihres Landes finden Sie auf der Website unter dem Abschnitt „rechtliche Informationen (im.natixis.com/intl/intl-fund-documents)

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: Senckenberganlage 21, 60325 Frankfurt am Main.

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.

Natixis Investment Managers sind berechtigt, die Vermarktung dieses Fonds nach Maßgabe der jeweils geltenden Rechtsvorschriften zu beenden

