

Stand: 31.07.2023

OSSIAM SOLACTIVE MOODY'S ANALYTICS IG EUR SELECT CREDIT UCITS ETF 1C (EUR)

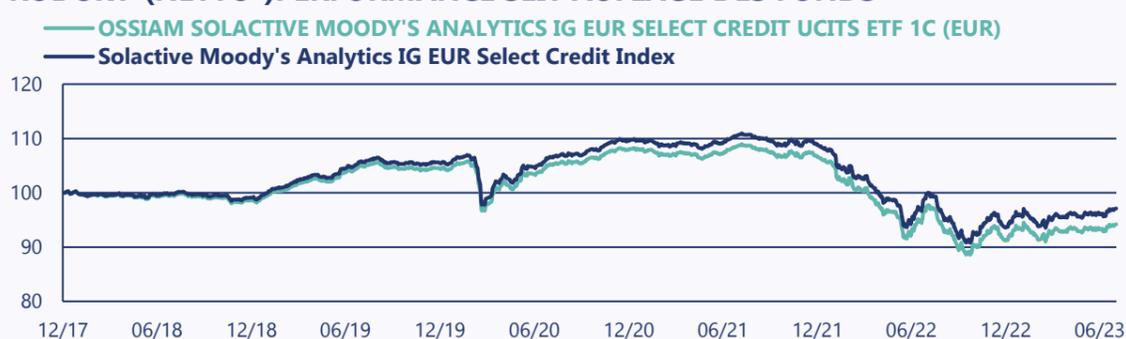
INVESTMENTSTRATEGIE

Der Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index bildet, basierend auf den Kreditrisiko-Kennzahlen von Moody's, die Wertentwicklung einer Auswahl von 100 Unternehmensanleihen aus dem Solactive Euro IG Corporate Index ab. Ziel des Index ist die Auswahl eines gleich gewichteten Portfolios von 100 liquiden Anleihen, die den von Moody's Analytics berechneten und bereitgestellten quantitativen Kennzahlen zufolge als unterbewertet gelten und gemäß der EDF™ eine geringe zu erwartende Kreditausfallwahrscheinlichkeit aufweisen. Ferner weist das Portfolio dasselbe Zinsrisiko sowie dasselbe Branchenrisiko wie die Benchmark auf. Die Gewichtung des Duration Buckets sowie die Gewichtung von Finanz- und Nicht-Finanz-Anleihen stimmen also mit den entsprechenden Gewichtungen in der Benchmark überein. Die Strategie schreibt eine maximale Gewichtung von 5% pro Emittent vor. Die Auswahl wird vierteljährlich überprüft.

Die Strategie hat folgende Ziele:

- Adressierung der Ineffizienzen klassischer Unternehmensanleihen-Benchmarks
- Wahrung eines niedrigen Kreditrisikos
- Maximierung der Gesamterträge einer liquiden und diversifizierten Auswahl von auf Euro lautenden Investment-Grade-Unternehmensanleihen

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS



Von Ossiam berechnete Daten zum 31.07.2023. Quelle: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive AG.

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre ann. %	5 Jahre ann. %	Seit Auflage ann. %
Fonds	0,96	3,22	-3,39	-3,62	-1,09	-1,07
Index	1,06	3,73	-2,69	-3,05	-0,54	-0,52
Investment Universum	1,01	3,06	-3,40	-3,45	-1,04	-0,99

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.07.2023. Quelle: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive AG.

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität Ann. %	Apha Ann. %	Beta	1-Jahr Tracking Error %	Ratio de Sharpe	höchster Wertverlust %
Fonds	3,82	-0,07	1,00	0,09	-0,26	-18,69
Index	3,82	0,47	1,00	---	-0,12	-18,16
Investment Universum	3,73	---	---	---	-0,25	-17,85

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.07.2023. Quelle: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive AG.

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 aus dem Index, Kreditrisiken, Risiken aus dem Einsatz von Derivaten sowie Ausfallrisiken, dem Risiko geografischer Konzentration und dem Risiko der Portfoliokonzentration ausgesetzt ist. Um mehr über die Risiken zu erfahren, lesen Sie bitte die Wesentlichen Anlegerinformation (KID) 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.

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 2 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.

INDEXDATEN

Name	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index (EUR)
Investment Universum	Solactive Euro IG Corporate Index (EUR)
Bloomberg Ticker	SOLMASCR Index
Auflagedatum	22.11.2017
Anlageklasse	Fixed Income
Häufigkeit der Neugewichtung	Quartalsweise

FONDSDATEN

Depotbank	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Rechtsform	Teilfonds des Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Classification SFDR	Article 6
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Anlagevolumen des Fonds	EUR 2 122 677
Anlagevolumen der Anteilsk	EUR 2 122 677
Nettoinventarwert	EUR 168.466
Anzahl der Anteile	12 600
Fondswährung	EUR
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU1093307442
Auflagedatum	29.12.2017
Replikationsmethode	Synthetic
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0.35%

HANDELSINFORMATION

Annahmeschluss 16:00 Uhr (Luxemburger 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 en EUR	OSXF GY
Euronext Paris en EUR	MOOC FP

TOP 10 POSITIONEN

	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index	Solactive Euro IG Corporate Index
PROSUS NV	2.02%	0.02%
BNP PARIBAS	2.01%	0.05%
SOCIETE GENERALE	2.01%	0.04%
UBS GROUP AG	2.00%	0.04%
THERMO FISHER SCIENTIFIC	1.99%	0.02%
DH EUROPE FINANCE	1.98%	0.03%
CPIPGR 1 1/2 01/27/31	1.05%	0.02%
DB 4 06/24/32	1.02%	0.05%
DB 5 5/8 05/19/31	1.02%	0.05%
DB 5 09/05/30	1.02%	0.06%

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.07.2023. Quelle: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive AG.

PORTFOLIOMERKMALE

	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index	Solactive Euro IG Corporate Index
DURATION (in years)	5.26	5.00
YIELD TO MATURITY	4.62%	4.09%

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.07.2023. Quelle: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive AG.

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.

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 Bank International GmbH, Luxemburg Branch, 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 (Zulassungnr. GP-10000016) zugelassen ist. Für die Vermarktung in Deutschland zugelassen.

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

„Das Finanzinstrument wird von der Solactive AG weder gesponsert noch beworben, verkauft oder auf sonstige Weise gefördert, und die Solactive AG gibt zu keiner Zeit eine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung im Hinblick auf die Ergebnisse einer Nutzung des Index und/oder der Indexmarke oder des Indexpreises oder in anderer Hinsicht. Der Index wird von der Solactive AG berechnet und veröffentlicht. Die Solactive AG bemüht sich, sicherzustellen, dass der Index richtig berechnet wird. Unabhängig von ihren Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten ist die Solactive AG nicht verpflichtet, Fehler im Index gegenüber Dritten anzuzeigen, insbesondere gegenüber Anlegern und/oder Finanzmittlern des Finanzinstruments. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung des Index oder der Indexmarke zur Nutzung in Verbindung mit dem Finanzinstrument stellen eine Empfehlung durch die Solactive AG zur Investition von Kapital in das entsprechende Finanzinstrument dar und sie stellen auch in keiner Weise eine Zusicherung oder Meinung der Solactive AG im Hinblick auf eine Investition in dieses Finanzinstrument dar.“

„Der Fonds wird von Moody's Analytics weder gesponsert noch beworben, verkauft oder auf sonstige Weise gefördert und Moody's Analytics gibt zu keiner Zeit eine vertragliche oder gesetzliche Garantie oder Zusicherung im Hinblick auf die Ergebnisse einer Nutzung des Index und/oder der Marke oder der Daten von Moody's Analytics oder in anderer Hinsicht ab. Bestimmte quantitative Finanzdaten, welche die Solactive AG bei der Berechnung und Veröffentlichung des Index verwendet, werden von Moody's Analytics zur Verfügung gestellt. Unbeschadet ihrer Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten und der Solactive AG ist Moody's Analytics nicht verpflichtet, Fehler im Index gegenüber Dritten, wie unter anderem Anlegern und/oder Finanzmittlern des Fonds, anzuzeigen. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung der Daten oder des Warenzeichens von Moody's Analytics zur Nutzung in Verbindung mit dem Index und dem Fonds stellen eine Empfehlung durch Moody's Analytics zur Investition von Kapital in den Fonds dar, und sie stellen auch in keiner Weise eine Zusicherung oder Meinung von Moody's Analytics im Hinblick auf eine Investition in dieses Finanzinstrument dar.“

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