MARKETING-KOMMUNIKATION

Stand: 30.04.2025

OSSIAM EUROPE ESG MACHINE LEARNING UCITS ETF 1C (EUR)

INVESTMENTSTRATEGIE

Anlageziel des Ossiam Europe ESG Machine Learning ist die Erwitschaftung der Nettogesamtrendite einer Auswahl vno in Europa notierten Aktien. Der fonds wird aktiv verwaltet und verwendet seine benchmark, den Solactive Eirope 600 Index NTR nur vu Vergleichswecken in Bezug auf Performance und Co2-Emissionen. Die Portfoliozusammensetzung des fonds ist nicht durch die benchmark bescharänkt und kann erheblich von den in der Benchmark enthaltenen Komponenten abweichen.
Der Anlageprozess des Fonds ist systematisch. Zuerst werden mehrere ESG-Filter angewendet, um Unternehmen zu entfernen:

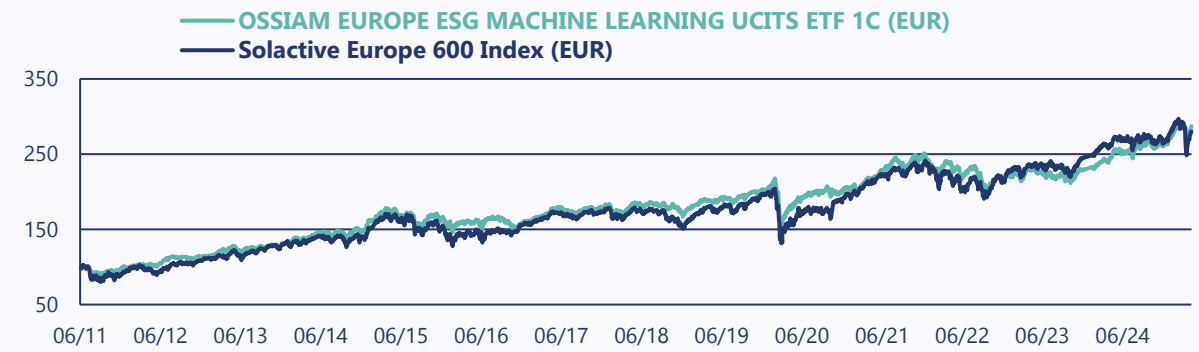
- Die in den umstrittenen Branchen Rüstungsgüter, Tabak oder Kohle tätig sind,
- Die schweren ESG-Kontroversen ausgesetzt sind,
- Die gegen eines der Prinzipien des UN Global Compact verstoßen
- Oder auf der Ausschlussliste der Norges Bank Investment Management stehen.

Die restlichen Bestände werden anschließend durch den Machine Learning-Algorithmus von Ossiam überprüft und anhand ihrer ESG-Profile als finanzielle Chancen oder Risiken klassifiziert. Das endgültige Portfolio besteht aus Aktien mit Wertsteigerungspotenzial, die entsprechend gewichtet sind, die Volatilität zu minimieren und die ESG-Ziele des Fonds zu erreichen.
Der ESG-Score des Portfolios strebt an, zehn Prozent über seiner investment universum, mit einem deutlich reduzierten CO2-Futßadruck (40-prozentige Reduktion der gesamten Treibhausgasemissionen), einer geringeren CO2-Intensität (gesamte Treibhausgasemissionen/Unternehmenseinnahmen) und weniger Emissionen aus fossilen Brennstoffen.

Wichtigste Vorteile:

- Nutzung von Machine Learning zur Identifizierung finanzieller Möglichkeiten aus ESG-Daten
- Erweitertes Risiko-Rendite-Profil
- Verbessertes ESG-Profil mit deutlicher Reduzierung der CO2-Bilanz

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.04.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre ann. %	5 Jahre ann. %	Seit Auflage ann. %
Fonds	1,14	9,41	17,30	6,22	9,76	7,90
Investment Universum	-0,70	5,58	6,99	8,01	11,68	7,71

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.04.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität Ann. %	Apha Ann. %	Beta	Sharpe Ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	12,47	2,66	0,68	0,60	-31,00
Investment Universum	16,54	---	---	0,44	-35,36

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.04.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

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 Investionsbetrag 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.**

RISIKOINDIKATOR

GERINGERES RISIKO — HÖHERES RISIKO

1 2 3 **4** 5 6 7

Wir haben den Fonds in die Risikoklasse 4 eingestuft, bei der es sich um eine mittlere Risikoklasse handelt. Mit anderen Worten: Die potenziellen Verluste im Zusammenhang mit den künftigen Ergebnissen des Produkts liegen auf einem mittleren Niveau, und wenn sich die Situation auf den Märkten verschlechtert, könnte unsere Zahlungsfähigkeit beeinträchtigt werden. Das Marktliquiditätsrisiko könnte die Schwankung der Produktperformance verstärken. Neben den im Risikoindikator enthaltenen Risiken können auch andere Risiken die Wertentwicklung des Fonds beeinflussen. Siehe Prospekt des Fonds.

INVESTMENT UNIVERSUM DATEN

Name	Solactive Europe 600 Index (EUR)
Bloomberg Ticker	EU600N Index
Auflagedatum	08.05.2006
Anlageklasse	Aktien
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

FONDSDATEN

Depotbank	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Rechtsform	Teilfonds des Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Classification SFDR	Article 8
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	EUR 59 179 207
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 16 512 845
Nettoinventarwert	EUR 277.387
Anzahl der Anteile	59 530
Fondswährung	EUR
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU0599612842
Auflagedatum	21.06.2011
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0.65%

HANDELSINFORMATION

Annahmeschluss	15.00 Uhr (Luxemburger Zeit)
Mindestanlagesumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil

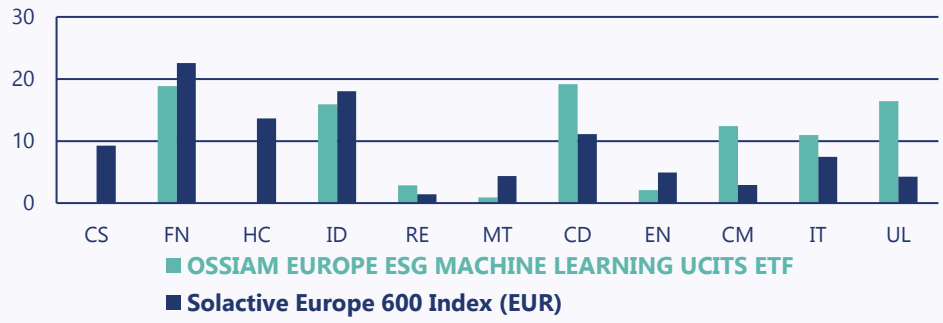
Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten

London Exchange in EUR	EUMV LN
London Exchange in GBP	LEMV LN
XETRA in EUR	OSX4 GY
SIX Swiss Exchange in EUR	EUMV SW
Borsa Italiana in EUR	EUMV IM

Risikohinweise: Der Referenzwert soll nicht mit den ökologischen oder sozialen Ambitionen des Fonds in Einklang gebracht werden. Bitte beachten Sie, dass der Fonds neben dem allgemeinen Marktrisiko auch spezifischen Risiken wie dem Index-, Derivate- und Gegenparteirisiken sowie den Risiken aus Schwellenländern aussetzt ist. Um mehr über die Risiken zu erfahren, lesen Sie bitte die Wesentlichen Anlegerinformation (KIID) und den Verkaufsprospekt vor einer Investition. 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.
*Die Fonds wechselten von einem passiv gemanagten Index-Tracking-ETF zu einem aktiv gemanagten ETF-Fonds, der ESG-Merkmale fördert. Die Fonds geschaltet von Name, Index und Benchmark: Zuvor Ossiam iSTOXX® Europe Minimum Variance NR ist jetzt Ossiam Europe ESG Machine Learning ; Der Referenzindex (bzw. Benchmark) war iSTOXX® Europe Minimum Variance NR (bzw. STOXX® Europe 600 Index) bis 22. Mai 2021 und ist jetzt Ossiam Europe ESG Machine Learning (bzw. Solactive Europe 600 Index NTR). Bitte beachten Sie, dass, wenn die Währung der Fonds/Aktienklasse von der Währung Ihrer Region abweicht, Verluste oder Gewinne, die von der Fonds/Aktienklasse generiert werden, durch Wechselkursschwankungen beeinflusst werden können (sowohl nach oben als auch nach unten).
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.

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 Ossiam berechnete Daten zum 30.04.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

TOP 10 POSITIONEN

	Ossiam Europe ESG Machine Learning UCITS ETF	Solactive Europe 600 Index
SAP SE	4.21%	2.44%
EXPERIAN PLC	4.16%	0.37%
IBERDROLA SA	4.00%	0.86%
WOLTERS KLUWER NV	3.97%	0.34%
ENGIE SA	3.80%	0.30%
DASSAULT SYSTEMES SE	3.77%	0.21%
TELEFONICA SA	2.97%	0.21%
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	2.82%	0.49%
VOLKSWAGEN AG	2.63%	0.16%
CREDIT AGRICOLE SA	2.56%	0.15%

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.04.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

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.
Für Anleger in der Schweiz: Der Vertreter und die Zahlstelle des Fonds in der Schweiz ist RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Zürich Branch, Bleicherweg 7, 8027 Zürich.
Das KIID in deutscher Sprache, sowie der Prospekt in englischer, sind kostenlos auf unserer Website verfügbar www.ossiam.com
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
Weitere Informationen zur ESG-Bewertungsmethodik des Fonds entnehmen Sie bitte dem Fondsprospekt und der Unternehmenswebsite des delegierten Anlageverwalters.
DER ZUGANG ZU PRODUKTEN UND DIENSTLEISTUNGEN IN DIESER PRÄSENTATION KANN FÜR BESTIMMTE PERSONEN ODER LÄNDER RESTRIKTIONEN AUFWEISEN. DIES KANN SICH AUS GENERELLEN REGELUNGEN ODER AUS MARKETINGGRÜNDEN ERGEBEN. KEIN PRODUKT UND KEINE DIENSTLEISTUNG AUS DIESEM DOKUMENT DARF DAHER EINER PERSON ANGEBOTEN WERDEN, DIE HIERZU RECHTLICH NICHT AUTORISIERT IST. DASSELBE GILT FÜR LÄNDER, IN DENEN OSSIAM NICHT FÜR DEN VERTRIEB ODER DAS MARKETING AUTORISIERT IST.

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.
Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt und die wesentlichen Informationen sorgfältig, bevor Sie investieren. Wenn der Fonds in Ihrem Land registriert ist, sind diese Dokumente auch auf der Website von Natixis Investment Managers (im.natixis.com/intl/intl-fund-documents) kostenlos und in der Amtssprache des Landes, in dem der Fonds registriert ist, erhältlich.
Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte in der Amtssprache Ihres Landes finden Sie in der Rubrik "Rechtliche Dokumentation" auf der Website (im.natixis.com/intl/intl-fund-documents).
In Deutschland und Österreich: Dieses Material wird von Natixis Investment Managers International oder ihrer Zweigniederlassung Natixis Investment Managers International, Zweigniederlassung Deutschland, bereitgestellt. Natixis Investment Managers International ist eine Portfoliomanagement Gesellschaft, die von der französischen Finanzaufsichtsbehörde AMF (Autorité des Marchés Financiers) unter der Nr. GP 90-009 zugelassen ist, und eine Aktiengesellschaft (société anonyme), die im Pariser Handels- und Gesellschaftsregister unter der Nr. 329 450 738 eingetragen ist. Eingetragener Sitz: 43 avenue Pierre Mendès France, 75013 Paris. Eingetragener Sitz von Natixis Investment Managers International, Zweigniederlassung Deutschland (Handelsregisternummer: HRB 129507) ist: Senckenberganlage 21, 60325 Frankfurt am Main.
Die oben erwähnten Gesellschaften sind Geschäftsentwicklungseinheiten von Natixis Investment Managers, einer Holdinggesellschaft mit einem breit gefächerten Angebot spezialisierter Vermögensverwaltungseinheiten und Distributionsgesellschaften weltweit. Die Vermögensverwaltungstochtergesellschaften von 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 für alle Investoren in allen Jurisdiktionen zugänglich.
Obwohl Natixis Investment Managers die in diesem Material 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 Material 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 -prozesse, auf die hier Bezug genommen wird, stellen die Ansichten der jeweiligen Person(en) zum angegebenen Datum dar. Diese sowie die dargestellten Portfoliobestände und -eigenschaften können sich ändern und sind nicht als vertraglich bindend zu betrachten. Es kann nicht zugesichert werden, dass die Entwicklungen so eintreten, wie sie in diesem Material prognostiziert werden. Die von externen Dritten geäußerten Analysen und Meinungen sind unabhängig und spiegeln nicht unbedingt die von Natixis Investment Managers wider. Informationen über die Wertentwicklung in der Vergangenheit sind kein Hinweis auf die zukünftige Wertentwicklung.
Dieses Material darf nicht als solches, 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 kann beschließen, die Vertriebsvereinbarungen für diesen Fonds in Übereinstimmung mit den einschlägigen Rechtsvorschriften zu beenden.