

Ossiam World ESG Machine Learning UCITS ETF 1A (USD)

INVESTMENTSTRATEGIE

Der Ossiam World ESG Machine Learning UCITS ETF zielt darauf ab, verbesserte risikoadjustierte Renditen der Aktienmärkte weltweiter Industrieländer nachzubilden, indem er maschinelles Lernen einsetzt, um Muster zwischen dem ESG-Profil (Environment, Social, Governance) des Unternehmens und der finanziellen Performance zu identifizieren. Die Aktienauswahl wird im Laufe der Zeit adjustiert, da der Algorithmus aus neuen ESG-Informationen lernt.

Der Anlageprozess des Fonds ist systematisch. Zuerst werden mehrere ESG-Filter angewendet, um Unternehmen zu entfernen:

- i) die in den umstrittenen Branchen Rüstungsgüter, Tabak oder Kohle tätig sind,
- (ii) die schweren ESG-Kontroversen ausgesetzt sind,
- (iii) die gegen eines der Prinzipien des UN Global Compact verstoßen
- (iv) 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.

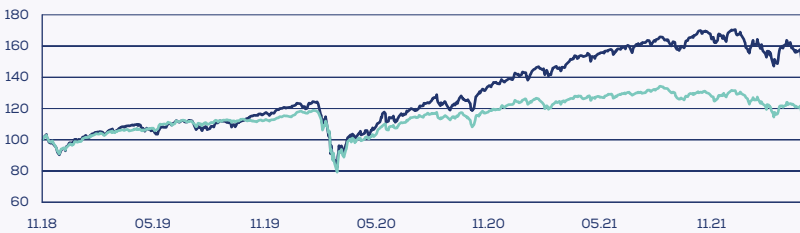
Der ESG-Score des Portfolios strebt an, zehn Prozent über seiner investment universum, mit einem deutlich reduzierten CO₂-Fußabdruck (40-prozentige Reduktion der gesamten Treibhausgasemissionen), einer geringeren CO₂-Intensität (gesamte Treibhausgasemissionen/Unternehmenseinnahmen) und weniger Emissionen aus fossilen Brennstoffen.

Entscheidende 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

— Ossiam World ESG Machine Learning UCITS ETF 1A (USD)
 — Solactive GBS World Developed Markets Large & Mid Cap Index NTR(USD)



Von Ossiam berechnete Daten zum 28.04.2022. Quelle: Ossiam, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflegung annualisiert %
Fonds	-5,12	-11,56	-8,24	2,92	-	4,49
Investment Universum	-6,20	-11,26	-1,89	11,21	-	12,78

Von Ossiam berechnete Daten zum 28.04.2022. Quelle: Ossiam, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLEGUNG DES FONDS

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	Sharpe ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	15,97	-4,97	0,74	0,22	-33,41
Investment Universum	19,55	-	-	0,61	-33,92

Von Ossiam berechnete Daten zum 28.04.2022. Quelle: Ossiam, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

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: 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 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. 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. 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	Solactive GBS World Developed Markets Large & Mid Cap Index NTR(USD)
Bloomberg Ticker	SDMLMCUN Index
Auflagedatum	08.05.2017
Anlageklasse	Aktien
Häufigkeit der Neugewichtung	Quartalsweise

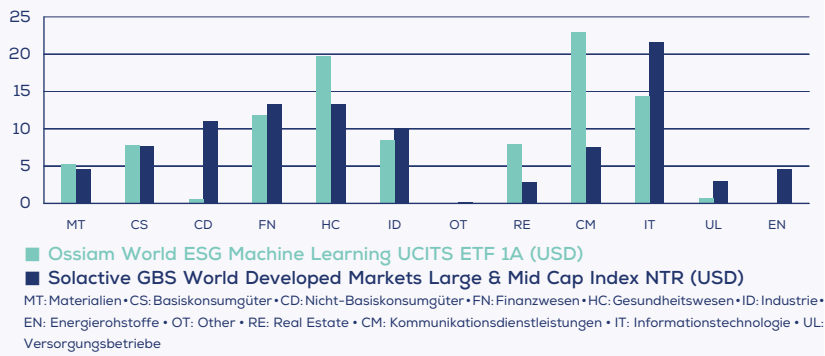
FONDSDATEN

Depotbank	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Rechtsform	Sub fund of Ossiam IRL ICAV
Kategorie	Actively Managed ETF
UCITS	Ja
Einstufung SFDR	Article 8
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	USD 77.057.550
Anlagevolumen der Anteilklasse	USD 44.811.423
Nettoinventarwert	USD 116.197
Anzahl der Anteile	385.649
Fondswährung	USD
Währung der Anteilklasse	USD
ISIN	IE00BF4Q3545
Auflagedatum	26.11.2018
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0,65%

HANDELSINFORMATION

Annahmeschluss	4:00 pm (Irish time)
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	OWLU LN
London Stock Exchange in GBP	OWLP LN
XETRA in USD	OWLU GY
SIX Swiss Exchange in USD	OWLU SW

SEKTOR ALLOKATION



Von Ossiam berechnete Daten zum 28.04.2022. Quelle: Ossiam, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

TOP 10 POSITIONEN (%)

	Ossiam World ESG Machine Learning UCITS ETF	Solactive GBS World Developed Markets Large & Mid Cap Index NTR
GILEAD SCIENCES INC	2,99	0,14
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,32	0,03
NORTONLIFELOCK INC	2,25	0,03
ELECTRONIC ARTS INC	2,22	0,06
GIVAUDAN-REG	2,18	0,06
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,17	0,13
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,98	0,03
ELISA OYJ	1,98	0,02
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,95	0,11
BECTON DICKINSON AND CO	1,91	0,13

Von Ossiam berechnete Daten zum 28.04.2022. Quelle: Ossiam, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

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.

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

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

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

Ausschließlich für professionelle Investoren - Bitte lesen Sie den Prospekt und das KIID, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen.

ossiam

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.

In der Brasilien: Die Produkte dürfen in Brasilien möglicherweise nicht öffentlich angeboten oder verkauft werden. Dementsprechend wurden und werden die Produkte weder bei der brasilianischen Wertpapier- und Börsenkommission (Comissão de Valores Mobiliários, das „CVM“) registriert noch der vorgenannten Agentur zur Genehmigung vorgelegt. Dokumente zu den Produkten sowie die darin enthaltenen Informationen dürfen in Brasilien nicht öffentlich zugänglich gemacht werden, da das Angebot von Produkten kein öffentliches Angebot von Produkten in Brasilien ist oder im Zusammenhang mit einem Angebot zum Abonnement oder Verkauf verwendet wird von Produkten für die Öffentlichkeit in Brasilien. Ein Verkäufer der Produkte kann vom Käufer aufgefordert werden, die Verfahrensbedingungen zum Nachweis des vorherigen Eigentums an den Produkten einzuhalten, und unterliegt möglicherweise der brasilianischen Steuer auf Kapitalgewinne, die vom Verkaufspreis einbehalten werden können. Personen, die Produkte in Brasilien anbieten oder erwerben möchten, sollten sich mit ihrem eigenen Anwalt über die Anwendbarkeit dieser Registrierungsanforderungen oder eine Ausnahme davon beraten.

In der Peru: Diese Produkte wurden nicht vor der Superintendencia del Mercado de Valores (SMV) registriert. Die SMV hat die dem Anleger zur Verfügung gestellten Informationen nicht überprüft. Dieses Dokument ist ausschließlich für institutionelle Kunden in Peru bestimmt und nicht für den öffentlichen Vertrieb bestimmt. Darüber hinaus unterliegen die Produkte nicht der Aufsicht der Banken-, Versicherungs- und Pensionskassenaufsicht (SBS).

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.