

**Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector TR UCITS ETF 1A (USD)**

**INVESTMENTSTRATEGIE**

Die Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector Strategy ist darauf ausgerichtet, ein mit dem Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Index vergleichbares Risiko- und Ertragsprofil zu erzielen, allerdings bei deutlich geringerem CO2-Ausstoß und einem besseren ESG-Profil.

Die Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Strategy verfolgt einen systematischen Value-Ansatz und stützt sich dabei auf die Erkenntnisse von Professor Robert Shiller. Die Strategie ermöglicht ein Exposure in Bezug auf US-Aktien. Dabei wird ein auf dem konjunkturebereinigten Kurs-Gewinn-Verhältnis (KGV) (CAPE®) basierendes Verfahren für die Sektorauswahl eingesetzt, um potenziell unterbewertete Sektoren zu ermitteln. Die Strategie soll eine Anlagemöglichkeit mit Value-Bias am Markt für Large Cap-Titel bieten und eignet sich für Buy-and-Hold-Anleger mit mehrjährigem Anlagehorizont.

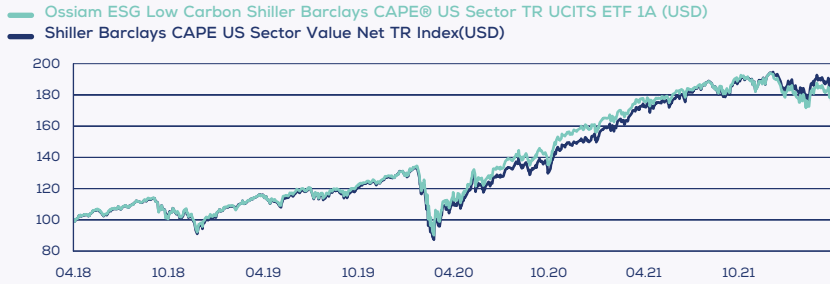
Verbessertes ESG-Profil: Im Rahmen der Strategie werden Unternehmen aussortiert, die im Bereich umstrittener Waffen, Tabak und Kohle tätig sind oder in Bezug auf Umweltfragen, soziale Aspekte und Governance kontrovers diskutiert werden.

Verbesserung des CO2-Fußabdrucks: Im Vergleich zum ursprünglichen Index strebt die Strategie eine Reduzierung der Gesamtreibhausgasemissionen, der Kohlenstoffintensität (Emissionen im Verhältnis zu den Unternehmensumsätzen) sowie der Treibhausgasemissionen aus fossilen Reserven um 40 Prozent an.

Wichtigste Vorteile:

- Exposure in Bezug auf US-Aktien durch Anwendung eines auf der CAPE®-Kennzahl basierenden Verfahrens für die Sektorauswahl
- Auf Grundlage der Erkenntnisse von Professor Shiller entwickelte und häufig genutzte Bewertungsgröße
- Anlageprozess zur Identifizierung von auf lange Sicht potenziell unterbewerteten Sektoren
- Ansatz, der die Anwendung von ESG-Kriterien mit Zielen hinsichtlich der Reduzierung von Treibhausgasemissionen vereint

**PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS**



Von Ossiam berechnete Daten zum 29.04.2022. Quelle: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

**(NETTO-)PERFORMANCE**

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflegung annualisiert %
Fonds	-5,82	-10,33	-2,46	14,44	-	14,32
Investment Universum	-5,49	-7,54	2,65	15,50	14,63	15,27

Von Ossiam berechnete Daten zum 29.04.2022. Quelle: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

**RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLEGGUNG DES FONDS**

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	Sharpe ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	21,43	-0,70	0,98	0,62	-33,04
Investment Universum	21,60	-	-	0,66	-34,70

Von Ossiam berechnete Daten zum 29.04.2022. Quelle: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

**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:** 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. 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. 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	Shiller Barclays CAPE US Sector Value Net TR Index (USD)
Bloomberg Ticker	BXIIICUSU Index
Auflagedatum	20.07.2015
Anlageklasse	Aktien
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

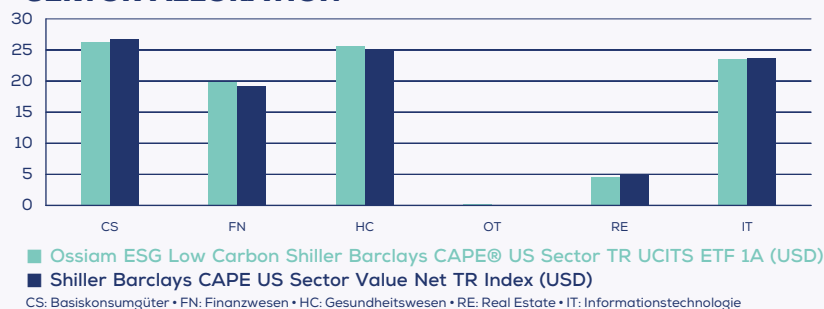
**FONDSDATEN**

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 645.307.023
Anlagevolumen der Anteilklasse	USD 256.242.266
Nettoinventarwert	USD 109,329
Anzahl der Anteile	2.343.774
Fondswährung	USD
Währung der Anteilklasse	USD
ISIN	IE00BF92LR56
Auflagedatum	05.04.2018
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0,75%

**HANDELSINFORMATION**

Annahmeschluss	15.00 Uhr (irische Zeit) an jedem Handelstag
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	SHED LN
London Stock Exchange in GBP	SHEP LN
XETRA in USD	SHED GY
SIX Swiss Exchange in USD	SHED SW

## SEKTOR ALLOKATION



Von OssiAm berechnete Daten zum 29.04.2022. Quelle: OssiAm, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

## TOP 10 POSITIONEN (%)

	OssiAm ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector TR UCITS ETF	Shiller Barclays CAPE US Sector Value Net TR Index
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,76	0,31
UNITEDHEALTH GROUP INC	4,73	2,42
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,69	0,16
APPLE INC	4,29	5,53
MICROSOFT CORP	4,28	5,33
COLGATE-PALMOLIVE CO	4,24	0,87
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,99	0,82
SYSCO CORP	3,74	0,58
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,17	1,10
PROLOGIS INC	2,73	0,60

Von OssiAm berechnete Daten zum 29.04.2022. Quelle: OssiAm, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

## 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 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 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 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](http://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](http://www.ossiam.com)

Weitere Informationen zur ESG-Bewertungsmethodik des Fonds entnehmen Sie bitte dem Fondsprospekt und der Unternehmenswebsite des delegierten Anlageverwalters. Barclays Bank PLC und die mit ihr verbundenen Unternehmen ("Barclays") sind weder Emittenten noch Herausgeber des OssiAm Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF, des OssiAm Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF oder des OssiAm ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF (zusammen, die "Produkte"). Barclays trägt gegenüber den Anlegern, die in die Produkte investieren, keine Verantwortung und hat diesen gegenüber keine Verpflichtungen oder Pflichten, außer im Zusammenhang mit dem Vertrieb aufgrund einer mit OssiAm geschlossenen Vereinbarung. Der Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index und der Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (zusammen, die "Indizes") sind zu Barclays Bank PLC gehörende, oder an diese zur Nutzung lizenzierte, Marken und wurden OssiAm Lux und/oder OssiAm IRL als "Emittenten" der Produkte per Lizenz zur Nutzung überlassen. Während OssiAm Lux und/oder OssiAm IRL, als Emittenten der Produkte und für sich selbst, Transaktionen mit Barclays in die oder bezüglich der Indizes im Zusammenhang mit den Produkten durchführen, erwerben Anleger die Produkte von OssiAm Lux und/oder OssiAm IRL. Anleger erwerben keine Rechte an den Indizes. Zwischen den Anlegern, die in die Produkte investieren und Barclays kommt keinerlei Beziehung zustande. Die Produkte werden von Barclays weder gesponsort noch empfohlen. Barclays gibt weder eine Zusicherung im Hinblick auf die Geeignetheit oder Zweckmäßigkeit einer Anlage in die Produkte noch im Hinblick auf den Gebrauch der Indizes oder jeglicher in diesen enthaltenen Daten ab, außer im Zusammenhang mit dem Vertrieb der Produkte gemäß eines Vertrages mit OssiAm. Barclays übernimmt gegenüber den Emittenten, den Anlegern oder sonstigen Dritten keine Haftung bezüglich des Gebrauchs oder der Richtigkeit der Indizes oder der in diesen enthaltenen Daten.

Die Shiller Barclays Indizes wurden teilweise von RSBB-I, LLC entwickelt, dessen Forschungsdirektor Robert J. Shiller ist. RSBB-I, LLC ist kein Anlageberater und übernimmt keine Gewähr für die Richtigkeit oder Vollständigkeit der Shiller Barclays-Indizes oder der darin enthaltenen oder zugrunde liegenden Daten oder Methoden. Weder RSBB-I, LLC noch Robert J. Shiller und sein Berater, IndexVestLAB, LLC und seine Berater, übernehmen keine Verantwortung für Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen und übernehmen keine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie für die Leistung oder die Ergebnisse, die durch einen Teil der Verwendung von Informationen entstehen enthalten oder auf denen die Indizes basieren, und lehnen ausdrücklich jegliche Gewährleistung der Marktgängigkeit oder Eignung für einen bestimmten Zweck in dieser Hinsicht ab und haften nicht für Ansprüche oder Verluste jeglicher Art, ob im Zusammenhang mit der Verwendung solcher Informationen, einschließlich aber nicht beschränkt auf Gewinneinbußen oder Straf- oder Folgeschäden, selbst wenn RSBB-I, LLC oder eine solche andere Partei von der Möglichkeit derselben Kenntnis erlangt.

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.