

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

OSSIAM EUROPE ESG MACHINE LEARNING (UCITS ETF 1C (EUR) ISIN: LU0599612842), ein Teilfonds der OSSIAM LUX SICAV

Verwaltungsgesellschaft: Ossiam, ein Unternehmen der Natixis-Gruppe

Ziele und Anlagepolitik

Anlageziel:

Anlageziel des OSSIAM EUROPE ESG MACHINE LEARNING (der „Fonds“) ist die Erwirtschaftung der Nettogesamtrendite einer Auswahl von in Europa notierten Aktien.

Der Fonds wird aktiv verwaltet und verwendet seine Benchmark, den Solactive Europe 600 Index NTR (die „Benchmark“) nur zu Vergleichszwecken in Bezug auf Performance und CO₂-Emissionen. Die Portfoliozusammensetzung des Fonds ist daher nicht durch die Benchmark beschränkt und kann erheblich von den in der Benchmark enthaltenen Komponenten abweichen.

Anlagepolitik:

Zur Verfolgung seines Anlageziels kann der Fonds Total Return Swaps mit dem Ziel einsetzen, synthetisch die Wertentwicklung eines Portfolios mit Aktien zu liefern, die gemäß der Anlagestrategie ausgewählt und gewichtet werden. Diese Methode beinhaltet ein Kontrahentenrisiko, wie im Risiko- und Ertragsprofil beschrieben. Der Nettoinventarwert je Anteil des Fonds wird daher entsprechend der Entwicklung des Aktienportfolios steigen (oder fallen). Der Kontrahent der Swaps ist ein erstklassiges Finanzinstitut, das auf diese Art von Geschäften spezialisiert ist. Der Fonds kann auch mehrere Swap-Vereinbarungen mit mehreren Swap-Kontrahenten abschließen, die ebenfalls die vorstehend beschriebenen Merkmale aufweisen.

Alternativ dazu kann der Fonds direkt in alle oder einen Teil der Aktienwerte anlegen, die unter Anwendung der Anlagestrategie ausgewählt werden.

Der Fonds wird in jedem Fall zu mindestens 75 % in Aktien oder Bezugsrechte von Unternehmen mit Sitz im Europäischen Wirtschaftsraum mit Ausnahme Liechtensteins investiert.

Darüber hinaus kann der Fonds ergänzend andere Derivate zu Absicherungs- und Anlagezwecken einsetzen, wie im Prospekt unter „Einsatz von Derivaten sowie besonderer Anlage- und Sicherungstechniken“ beschrieben. Referenzwährung des Fonds ist der Euro.

Anlagestrategie:

Die Verwaltungsgesellschaft verwendet ein quantitatives Modell, das einen regelbasierten Ansatz verfolgt, mit dem Large- und Mid-Cap-Aktien aus Industrieländern auf der Grundlage von Finanzdaten und ESG-Ratings (Umwelt, Soziales, Unternehmensführung) bewertet werden sollen.

Das Modell wendet zunächst einen Ethikfilter (wie im Prospekt definiert) an, um Wertpapiere auszuschließen, die unter anderem gegen die 10 Grundsätze des UN Global Compact verstoßen oder in erheblichem Umfang in der Kohleindustrie tätig sind.

Wertpapiere, die den Ethikfilter bestehen, werden dann anhand des Modells der Verwaltungsgesellschaft, das sowohl ESG- als auch Finanzdaten verwendet, weiter überprüft.

Die Verwaltungsgesellschaft bestimmt dann mithilfe eines Optimierungsverfahrens die Gewichtungen der Aktien, die mit dem quantitativen Modell so ausgewählt werden, dass das Portfolio eine Reihe von Beschränkungen einhält, einschließlich einer Reduzierung der gesamten Treibhausgasemissionen und der potenziellen Treibhausgasemissionen aus Reserven des Portfolios im Vergleich zur Benchmark um 40 % und eines ESG-Ratings des Portfolios, das mindestens 10 % über dem der Benchmark liegt.

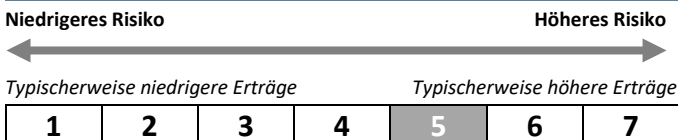
Unter bestimmten Marktbedingungen ist es eventuell nicht möglich, die Gewichtungsoptimierung unter genauer Einhaltung aller Beschränkungen vorzunehmen. Unter solchen Umständen kann die Verwaltungsgesellschaft einen Teil der Beschränkungen proportional reduzieren.

Eine detaillierte Beschreibung der Anlagestrategie (einschließlich der ESG-Strategie des Fonds) finden Sie im Abschnitt „Anlagestrategie“ im entsprechenden Fondsanhang des Prospekts.

Die UCITS ETF 1C (EUR)-Anteile sind an mindestens einer Börse zum Handel notiert und Anleger können Anteile über ihren üblichen Broker an jedem Handelstag der entsprechenden Börse(n), der auch ein Handelstag ist, oder über eine Fondsplattform kaufen oder verkaufen. Wenn Sie weitere Informationen wünschen, wenden Sie sich bitte an Ihren Broker. Die Anteilsklasse UCITS ETF 1C(EUR) ist eine thesaurierende Anteilsklasse, d.h. aus dem Fonds erzielte Erträge werden reinvestiert. Weitere Informationen finden Sie im Abschnitt „Zeichnung, Übertragung, Umtausch und Rücknahme von Anteilen“ sowie im Abschnitt „Praktische Informationen“ des Fondsanhangs im Prospekt.

Empfehlung: Dieser Fonds ist unter Umständen für Anleger nicht geeignet, die ihr Geld innerhalb eines Zeitraums von weniger als 5 Jahren aus dem Fonds wieder zurückziehen wollen.

Risiko- und Ertragsprofil



Auf der Skala des synthetischen Risiko-Ertrags-Indikators erreicht die Anteilsklasse die Stufe 5. Dieser Indikator basiert auf historischen Daten. Aufgrund seines Engagements an den Aktienmärkten kann der Fonds eine erhebliche Volatilität verzeichnen, was sich in der Einstufung auf der obigen Skala niedergeschlagen 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.

Spezielle Risikoerwägungen

Marktrisiko: Der Wert der Fondsanteile ist von Aktien abhängig, deren Wert steigen oder fallen kann. Die Anleger sollten daher beachten, dass der Wert ihrer Anlage sowohl fallen als auch steigen kann, und sie sollten akzeptieren, dass es keine Garantie dafür gibt, dass die Strategie des Fonds in der Tat zu einer Rendite führt, die über einer vergleichbaren Anlagestrategie liegt, oder dass sie ihr ursprünglich investiertes Kapital zurückerhalten.

Derivate- und Kontrahentenrisiko: Fonds können börsennotierte und nicht börsennotierte Derivatekontrakte abschließen, um ein Engagement in den Basiswerten aufzubauen oder um ihre Direktanlagen abzusichern. Wertschwankungen der Basiswerte haben zur Folge, dass sich die Zahlungen im Rahmen dieser Kontrakte ändern. Durch diese Kontrakte kann sich das Marktrisiko der Fonds erhöhen, was in einigen Fällen zu höheren Verlusten führen kann.

ESG-Risiko: Es besteht das Risiko, dass sich ESG-Anlagen schlechter entwickeln als der Gesamtmarkt. ESG-Informationen von externen Datenanbietern können unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein. Daher besteht ein Risiko, dass die Verwaltungsgesellschaft ein Wertpapier oder einen Emittenten falsch beurteilt, so dass ein Wertpapier zu Unrecht in das Portfolio eines Fonds aufgenommen oder daraus ausgeschlossen wird.

Weitere Einzelheiten zu den Risiken entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Allgemeine Risiken“ im Verkaufsprospekt.

Kosten für diese Anteilsklasse

Die von Ihnen getragenen Kosten werden für den Betrieb des Fonds verwendet, einschließlich der Vermarktung und des Vertriebs der Fondsanteile. Diese Kosten reduzieren das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage.

Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

Ausgabeaufschlag	Maximaler Ausgabeaufschlag 3,00% Maximale Gebühr für Zeichnungen, die an den Fonds zu zahlen ist 1,00 %
Rücknahmeabschlag	Maximaler Rücknahmeabschlag 3,00 % Maximale Gebühr für Rücknahmen, die an den Fonds zu zahlen ist 1,00 %

Dabei handelt es sich um den Höchstbetrag, der von Ihrer Anlage vor der Anlage oder vor der Auszahlung Ihrer Rendite abgezogen wird.

Kosten, die vom Fonds im Laufe des Jahres abgezogen werden

Laufende Kosten: 0,65 % p.a.

Kosten, die der Fonds unter bestimmten Umständen zu tragen hat:

An die Wertentwicklung gebundene Gebühren: -

Bei den angegebenen **Ausgabeauf-** und **Rücknahmeabschlägen** handelt es sich um Höchstbeträge. Unter Umständen wird Ihnen weniger belastet. Ihr Finanzberater kann Ihnen weitere Informationen geben.

Falls ein Anleger einen exzessiven Handel betreibt oder Market-Timing praktiziert, kann von ihm eine zusätzliche Gebühr von bis zu 2,00% erhoben werden.

Die **laufenden Kosten** beziehen sich auf das am 31. Dezember 2020 abgelaufene Geschäftsjahr. Dieser Wert kann von Jahr zu Jahr schwanken. Er enthält keine Portfoliotransaktionskosten mit Ausnahme von Ausgabeaufschlägen/Rücknahmeabschlägen, die die SICAV beim Kauf oder Verkauf von Anteilen anderer Organismen für gemeinsame Anlagen zahlt.

Weitere Informationen zu den Kosten finden Sie in den Kapiteln „Gebühren und Aufwendungen“ und „Zeichnung, Übertragung, Umtausch und Rücknahme von Anteilen“ im Fondsprospekt. Dieser ist über die Website www.ossiam.com abrufbar.

Historische Performance



Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Hinweis auf künftige Ergebnisse.

Dieses Balkendiagramm zeigt die Wertentwicklung der Anteilsklasse UCITS ETF 1C (EUR) in ihrer Notierungswährung. Es berücksichtigt die laufenden Kosten, nicht jedoch die Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge.

Datum der Fonderrichtung: 21. Juni 2011

Datum der Auflegung der Anteilsklasse: 3. Februar 2012.

Der Fonds war bis zum 21.05.2021 ein passiv verwalteter OGAW ETF, der den iSTOXX® Europe Minimum Variance Index Net Return (der „Index“) nachbildete. Das nebenstehende Bardiagramm zeigt die Wertentwicklung des Fonds einerseits und des Index andererseits. Es spiegelt die Wertentwicklung der Benchmark (anstelle des Index) wider, wenn diese für den Zeitraum ab dem 22.05.2021 (wenn der Fonds aktiv verwaltet wird) verfügbar wird.

Praktische Informationen

Verwah- und Verwaltungsstelle des Fonds:

State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
49, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft:

Ossiam
6, place de la Madeleine
75008 Paris, Frankreich

Handelsfrist: 15.30 Uhr Handelsschluss: 16:00 Uhr (Luxemburger Zeit)

Der indikative Nettoinventarwert des Fonds wird auf Echtzeit-Basis berechnet. Bis zum 21.05.2021 kann der indikative Nettoinventarwert auf www.euronext.com abgerufen werden. Ab dem 22.05.2021 wird er auf www.solactive.com veröffentlicht. Die Informationen über das Portfolio des Fonds sind in den Jahres- und Halbjahresberichten des Fonds enthalten und können auf der Website der Verwaltungsgesellschaft (www.ossiam.com) eingesehen werden.

Weitere Informationen über die SICAV und den Fonds können kostenlos am Geschäftssitz der Verwaltungsgesellschaft oder der Verwah- und Verwaltungsstelle angefordert werden. Hierzu zählen die englischen Fassungen des Verkaufsprospekts, der Berichte und Abschlüsse der gesamten SICAV sowie Informationen zum Verfahren für den Umtausch von Anteilen zwischen Teilfonds. Der Anteilspreis des Fonds ist über www.ossiam.com abrufbar und kann auch am Geschäftssitz der Verwaltungsgesellschaft oder bei der Verwaltungsstelle angefordert werden.

Die aktuelle Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft einschließlich einer Beschreibung, wie Vergütungen und Vergünstigungen berechnet werden, kann unter www.ossiam.com abgerufen werden. Ein Druckexemplar wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds sind rechtlich voneinander getrennt. Die Rechte der Anleger und Gläubiger bezüglich eines Teilfonds sind daher auf die Vermögenswerte dieses Teilfonds begrenzt, sofern die Gründungsunterlagen der SICAV nichts anderes vorsehen.

Der Fonds unterliegt in Luxemburg unter Umständen einer speziellen steuerlichen Behandlung. Abhängig von dem Land, in dem Sie ansässig sind, könnte sich dies auf Ihre Anlage auswirken. Dieser Fonds erfüllt die Voraussetzungen für den französischen Sparplan PEA für französische Anleger. Für weitere Informationen wenden Sie sich bitte an einen Berater. Dieser Fonds erfüllt die Voraussetzungen für einen „Aktienfonds gemäß dem deutschem Investmentgesetz“, wie im Prospekt unter „Besteuerung“ näher ausgeführt.

Anteilsklasse	Art der	Art der Anleger	Währung	Mindestzeichnungsanforderungen	Mindestrücknahmeanforderungen	Ausschüttungs-
UCITS ETF 1C (EUR)	LU0599612842	Alle Anleger*	Euro	1.000.000 EUR	1.000.000 EUR	Thesaurierung

* Zeichnungen am Primärmarkt nur für autorisierte Teilnehmer und zugelassene Anleger.

Ossiam kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Fondsprospekts vereinbar ist.

Der Fonds ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die *Commission de Surveillance du Secteur Financier* (CSSF) reguliert.

Ossiam ist in Frankreich zugelassen und wird durch die *Autorité des Marchés Financiers* (AMF) reguliert.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand von 22.05.2021.