

Stand: 30.09.2022

OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE US SECTOR VALUE TR - UCITS ETF 1C (EUR)

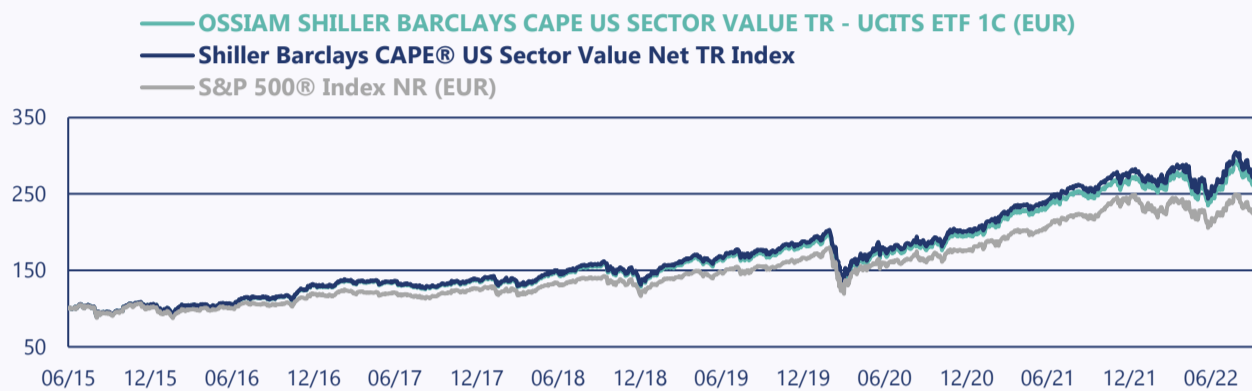
INVESTMENTSTRATEGIE

Die Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Strategie ist eine systematische Value-Strategie, die auf den Forschungsarbeiten von Professor Robert Shiller basiert. Die Strategie ermöglicht die Investition in einen Sektor-Selektions-Ansatz, welcher basierend auf dem Cyclically Adjusted Price-to-Earnings (CAPE) Ratio potentiell unterbewertete Sektoren identifiziert. Zielsetzung der Strategie ist die Bereitstellung eines Portfolios, welches tendenziell aus Unternehmen mit einer höheren Marktkapitalisierung und einem Value-Bias besteht. Die Strategie ist insbesondere für Investoren mit einem mehrjährigen Investitionshorizont geeignet.

Im Einzelnen bietet die Strategie:

- Positionen in US Aktien mit einem Sektor-Selektions-Ansatz basierend auf dem CAPE Ratio
- Einen weltweit genutzten Bewertungsansatz basierend auf den Forschungsarbeiten von Professor Shiller
- Einen Investmentprozess, der über einen langfristigen Investitionshorizont potentiell unter-bewertete Sektoren identifiziert

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2022. Quelle: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre ann. %	5 Jahre ann. %	Seit Auflage ann. %
Fonds	-7,53	-6,33	3,22	13,58	14,35	13,59
Index	-7,51	-6,02	3,69	14,09	15,01	14,18
Investment Universum	-6,85	-11,94	-0,46	11,52	12,80	11,18

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2022. Quelle: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

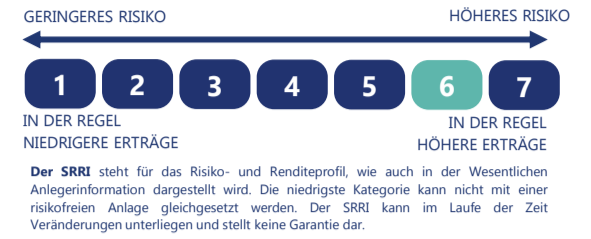
	Volatilität Ann. %	Apha Ann. %	Beta	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe Ratio	Perte Max. %
Fonds	20,57	2,61	0,98	0,03	0,68	-34,48
Index	20,59	3,19	0,98	---	0,71	-34,50
Investment Universum	20,49	---	---	---	0,56	-33,63

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2022. Quelle: Ossiam, Bloomberg, Barclays, 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: Es ist zu beachten, dass der Fonds neben dem allgemeinen Marktrisiko verschiedenen Risiken ausgesetzt ist. Hierzu gehören unter anderem Risiken aus dem Index, dem Einsatz von Derivaten, dem Gegenpartierisiko und dem Risiko von geographisch konzentrierteren Investitionen. Um mehr über die Risiken zu erfahren, lesen Sie bitte die Wesentlichen Anlegerinformation (KIID) 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.

SYNTHETISCHER RISIKO- UND ERTRAGSINDIKATOR (SRRI)



INDEXDATEN

Name	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index (EUR)
Investment Universum	S&P 500® Index NR (EUR)
Bloomberg Ticker	BXICUSU Index
Auflegedatum	05.10.2012
Anlageklasse	Aktien
Häufigkeit der Neugewichtung	Monatlich

FONDSDATEN

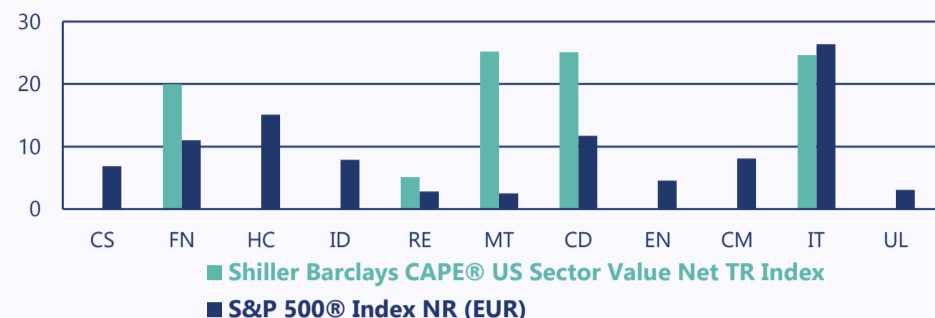
Depotbank	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Rechtsform	Teilfonds des Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Classification SFDR	Article 6
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Non
Anlagevolumen des Fonds	USD 1 866 231 667
Anlagevolumen der Anteilklasse	USD 496 072 149
Nettoinventarwert	USD 973.127
Anzahl der Anteile	509 771
Fondswährung	USD
Währung der Anteilklasse	EUR
ISIN	LU1079841273
Auflegedatum	22.06.2015
Replikationsmethode	Synthetisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0.65%

HANDELSINFORMATION

Annahmeschluss 4:00 pm Luxembourg time
Mindestanlagesumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten) 1 Anteil

London Stock Exchange in USD	UCAP LN
London Stock Exchange in GBP	CAPU LN
SIX Swiss Exchange in USD	UCAP SW

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 30.09.2022. Quelle: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's

TOP 10 POSITIONEN

	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index	S&P 500® Index NR
APPLE INC	5.74%	6.93%
AMAZON.COM INC	5.62%	3.33%
MICROSOFT CORP	5.59%	5.77%
TESLA INC	5.46%	2.35%
LINDE PLC	4.48%	0.45%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	2.91%	1.60%
JPMORGAN CHASE & CO	1.85%	1.02%
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1.72%	0.17%
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1.61%	0.16%
CORTEVA INC	1.37%	0.14%

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.09.2022. Quelle: Ossiam, Bloomberg, Barclays, 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 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.

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 JEDLICHE GEWÄHRLEISTUNG DER MARKTGÄNGIGKEIT ODER EIGNUNG FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK IN DIESER HINSICHT AB UND HAFTEN NICHT FÜR ANSPRÜCHE ODER VERLUSTE JEDLICHER 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. 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 KIID in deutscher Sprache, sowie der Prospekt in englischer, sind kostenlos auf unserer Website verfügbar www.ossiam.com

• 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. • 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).

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.

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.

 **NATIXIS**
INVESTMENT MANAGERS

 **ossiam**
smart • sustainable • solutions