

Ossiam Global Multi-Asset Risk-Control UCITS ETF 1C (EUR)

INVESTMENTSTRATEGIE

Die Global Multi-Asset Risk-Control Strategie nutzt einen systematischen und modernen Portfoliooptimierungsansatz, um flexibel Allokationen in verschiedene Anlageklassen umsetzen zu können. Die Strategie ermöglicht Positionen in bis zu sieben verschiedene Anlageklassen, von Aktien, Staats- sowie Unternehmensanleihen in Industrie- und Entwicklungsländern, über High Yield Unternehmensanleihen bis hin zu Rohstoffen und Immobilien. Die Portfoliokonstruktion basiert auf einem Mittelwert-Varianz-Ansatz, wobei die Parameter der einzelnen Anlageklasse aus US-Dollar-Sicht ermittelt werden.

Der Wertverlust der Strategie wird durch einen CPPI-ähnlichen Ansatz (Constant Proportion Portfolio Insurance) mit dynamischem Portfoliomindestwert sowie Multiplikator begrenzt. Die Allokation erfolgt quartalsweise, wobei die Frequenz auf monatliche Neugewichtung erhöht werden kann, sofern die Volatilität im Markt (gemessen am US Aktienmarkt) deutlich ansteigt.

Die Umsetzung des Portfolios in den verschiedenen Anlageklassen sowie den Geldmarktpositionen für den CPPI-ähnlichen Ansatz erfolgt über eine Auswahl liquider ETFs.

Im Einzelnen bietet die Strategie:

- Ein global diversifiziertes Portfolio über verschiedene Anlageklassen
- Eine dynamische Anpassung der Portfoliostruktur
- Einen innovativen CPPI-ähnlichen Ansatz, um den maximalen Wertverlust über die jeweils letzten 6 Monate auf unter 8% zu begrenzen, während gleichzeitig eine 100%ige Geldmarktposition vermieden wird

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS

Ossiam Global Multi-Asset Risk-Control UCITS ETF 1C (EUR)
EONIA Total Return Index(EUR)



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.11.2021. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive AG

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflage annualisiert %
Fonds	-1,14	4,57	6,39	3,19	-	1,91
Index	-1,02	5,97	7,93	4,80	-	3,36
Eonia	-0,04	-0,45	-0,49	-0,45	-0,41	-0,41

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.11.2021. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive AG

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe Ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	5,50	4,47	6,18	0,15	0,42	-15,32
Index	5,51	4,53	2,82	-	0,69	-14,90
Eonia	0,02	-	-	-	-	-2,02

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.11.2021. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive AG

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)



IN DER REGEL NIEDRIGERE ERTRÄGE (1-3) | IN DER REGEL HÖHERE ERTRÄGE (5-7)

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.

INDEXDATEN

Name	Global Multi-Asset Risk Control Index (EUR)
Eonia	EONIA Total Return Index (EUR)
Bloomberg Ticker	SGKMGMRC Index
Auflegedatum	09.04.2021
Anlageklasse	Multi Asset
Häufigkeit der Neugewichtung	Quartalsweise (optional monatlich)

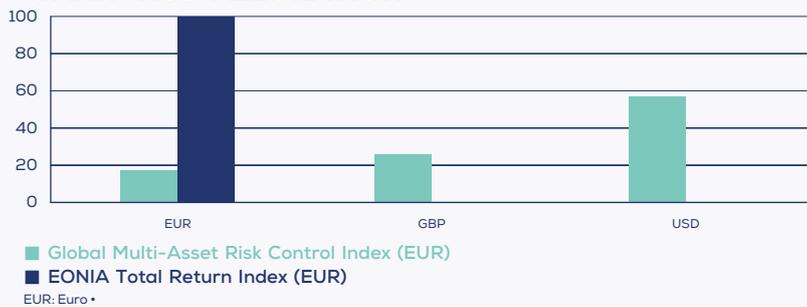
FONDSDATEN

Depotbank	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Rechtsform	Teilfonds des Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Einstufung SFDR	Article 6
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Anlagevolumen des Fonds	EUR 101.847.621
Anlagevolumen der Anteilklasse	EUR 101.847.621
Nettoinventarwert	EUR 293,867
Anzahl der Anteile	346.577
Fondswährung	EUR
Währung der Anteilklasse	EUR
ISIN	LU1446552496
Auflegedatum	28.12.2016
Replikationsmethode	Synthetisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Sonstiger Fonds
Total Expense Ratio	0,55%

HANDELSINFORMATION

Annahmeschluss	17:00 Uhr (Luxemburger Zeit) (T-1)
Mindestanlagensumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse)	1 Anteil
Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten	
XETRA in EUR	OSXM GY
Euronext Paris in EUR	GMRC FP

WÄHRUNGS-ALLOKATION



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.11.2021. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive AG

TOP 10 POSITIONEN (%)

Position	Global Multi-Asset Risk Control Index (%)
ISHARES CORE S&P 500 UCITS ETF	19,95
ISHARES CORE UK GILTS UCITS ET	19,27
ISHARES EURO STOXX 50 UCITS ET	18,65
ISHARES J.P. MORGAN USD EM BON	14,88
ISHARES USD CORP BOND UCITS ET	11,86
ISHARES US PROPERTY YIELD UCIT	10,41
ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ET	6,42
UKXEU1F	0,19
EUDOL1F	-1,62

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.11.2021. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive AG

KONTAKT / INFO

www.ossiam.com
 mail : info@ossiam.com
 TEL +33 1 84 79 42 70
 80 av. de la Grande Armée
 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.

Das KIID in deutscher Sprache, sowie der Prospekt in englischer, sind kostenlos auf unserer Website verfügbar www.ossiam.com

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

Weder die Commerzbank Aktiengesellschaft noch ihre verbundenen Gesellschaften (gemeinsam „Commerzbank“) sind die Emittenten oder Ersteller des Ossiam Global Multi-Asset Risk-Control ETF (der „ETF“), und die Commerzbank hat keine Verantwortlichkeiten, Verpflichtungen oder Pflichten gegenüber Anlegern des ETF. Der Global Multi Asset Risk Control Index (der „Index“) wurde von OSSIAM (der „Emittent“) als Emittent des ETF lizenziert. Die einzige Beziehung der Commerzbank zum Emittenten im Hinblick auf den ETF ist die Lizenzierung des Index, der von der Commerzbank oder einem ihrer Nachfolger ohne Berücksichtigung des Emittenten, des ETF oder der Inhaber des ETF festgelegt, zusammengestellt und berechnet wird. Der ETF wird von der Commerzbank oder Dritten, die in irgendeiner Weise an der Zusammenstellung, Berechnung oder Erstellung des Index betraut sind, nicht gesponsert, empfohlen, verkauft oder beworben. Die Commerzbank macht keine Zusagen und gibt keine Garantie, weder ausdrücklich noch stillschweigend, hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in den ETF, hinsichtlich der Ratsamkeit einer Anlage in Wertpapieren im Allgemeinen oder hinsichtlich der Fähigkeit des Index, die jeweilige oder relative Entwicklung des Marktes nachzubilden. Die Commerzbank hat die Gesetzlichkeit oder Eignung des ETF im Hinblick auf irgendeine natürliche oder juristische Person weder geprüft noch in irgendeiner Weise in Betracht gezogen. Die Commerzbank ist nicht verantwortlich für die und war nicht beteiligt an der Festlegung des Zeitpunkts, der Preise oder der Anzahl der auszugebenden Anteile des ETF. Die Commerzbank ist nicht dazu verpflichtet, die Bedürfnisse des Emittenten oder der Inhaber des ETF oder von Dritten bei der Festlegung, Zusammenstellung oder Berechnung des Index zu berücksichtigen. Die Commerzbank trägt keine Verpflichtung oder Haftung in Verbindung mit der Verwaltung, Vermarktung des oder dem Handel mit dem ETF. Weder die Commerzbank noch ihre Lizenzgeber haften gegenüber dem emittenten, anlegern oder sonstigen dritten für die Qualität, Richtigkeit und/oder vollständigkeit des index oder darin enthaltener daten oder für unterbrechungen bei der bereitstellung des index. Die Commerzbank gibt keine garantie, weder ausdrücklich noch stillschweigend, hinsichtlich der vom emittenten, anlegern oder anderen natürlichen oder juristischen personen durch die nutzung des index oder darin enthaltener daten zu erzielenden ergebnisse. Die Commerzbank gibt keine garantien, weder ausdrücklich noch implizit, und lehnt hiermit jegliche garantie hinsichtlich der marktgängigkeit oder eignung für einen bestimmten zweck oder einsatz für den index oder darin enthaltene daten ab. Die Commerzbank behält sich das recht vor, die methoden der berechnung oder veröffentlichung zu ändern oder die berechnung oder veröffentlichung des index einzustellen, und Commerzbank ist nicht haftbar für fehlerhafte berechnungen oder falsche, verspätete oder unterbrochene veröffentlichungen in bezug auf den index. Die Commerzbank haftet nicht für schäden, insbesondere spezielle, indirekte oder folgeschäden, oder für entgangene gewinne, selbst wenn sie von der möglichkeit solcher in kenntnis gesetzt wurde, die aus der nutzung des index oder darin enthaltener daten oder im hinblick auf den etf oder anderweitig entstehen.

Die durch die Commerzbank bereitgestellten und in dieser Veröffentlichung genutzten Daten dürfen in keiner Weise ohne die vorherige schriftliche Genehmigung der Commerzbank reproduziert werden.

Copyright © Commerzbank 2016. Alle Rechte vorbehalten.

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.