

Ossiam US Steepener UCITS ETF 1C (USD)

INVESTMENTSTRATEGIE

Das Anlageziel des Ossiam US Steepeners ist es, die Wertentwicklung des Solactive US Treasury Yield Curve Steepener 2-5 vs. 10-30 Index nachzubilden. Der Index ist in Futures auf US-Treasury-Anleihen investiert und soll von einer Versteilerung der USD-Zinssätze profitieren, gemessen als Differenz zwischen langfristigen (10 und 30 Jahre) und kurzfristigen (2 und 5 Jahre) Zinssätzen, dabei jedoch die Sensitivität gegenüber einer parallelen Verschiebung der Zinsstrukturkurve begrenzen.

Der Index erreicht sein Ziel durch den Kauf von kurzfristigen US-Treasury-Futures und den Verkauf von langfristigen US-Treasury-Futures.

Um die Empfindlichkeit des Portfolios gegenüber einer Parallelverschiebung der Zinsstrukturkurve zu begrenzen, werden die „Long“ und die „Short“ Positionen bei jeder Neugewichtung angepasst, um eine durationsneutrale Position gegenüber den USD-Zinsen zu erreichen.

Die Strategie:

- Bietet ein durationsneutrales Engagement gegenüber der Versteilerung der US-Zinsstrukturkurve
- Profitiert von einer möglichen Versteilerung der US-Zinsstrukturkurve

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS

Ossiam US Steepener UCITS ETF 1C (USD)
Fed Funds(USD)



Von Ossiam berechnete Daten zum 31.05.2022. Quelle: Ossiam, Standard & Poor's

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre annualisiert %	5 Jahre annualisiert %	Seit Auflage annualisiert %
Fonds	1,83	-1,85	-7,27	-	-	-0,68
Index	1,88	-1,58	-6,74	-0,13	-	-0,10
Investment Universum	0,07	0,12	0,17	0,59	-	0,48

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.05.2022. Quelle: Ossiam, Standard & Poor's

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität annualisiert %	Alpha % annualisiert	BETA	1-Jahr Tracking Error %	Sharpe Ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	4,60	-	-	0,03	-0,26	-11,69
Index	4,60	-	-	-	-0,13	-11,17
Investment Universum	0,06	-	-	-	-	0,00

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.05.2022. Quelle: Ossiam, 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 aus dem Index, Kreditrisiken, Risiken aus dem Einsatz von Derivaten sowie Ausfallrisiken, Hebelungsrisiko, dem Risiko geografischer Konzentration und dem Risiko der Portfoliokonzentration ausgesetzt ist. Um mehr über die Risiken zu erfahren, lesen Sie bitte die Wesentlichen Anlegerinformation (KIID) und den Verkaufsprospekt vor einer Investition.

*Für Fonds mit einem Track Record von weniger als 1 Jahr wird kein Tracking Error veröffentlicht.

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.

INDEXDATEN

Name	Solactive US Treasury Yield Curve Steepener 2-5 vs 10-30 Index (USD)
Investment Universum	Fed Funds (USD)
Bloomberg Ticker	SOUSTFTT Index
Auflegedatum	09.05.2019
Anlageklasse	Fixed Income
Häufigkeit der Neugewichtung	vierteljährlich

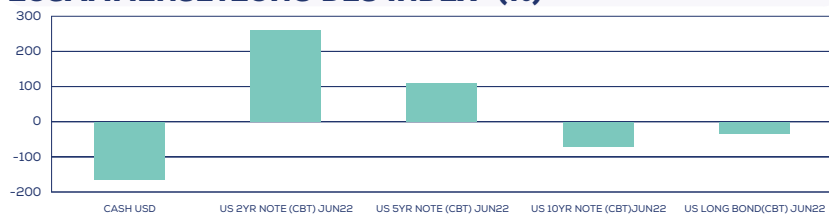
FONDSDATEN

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	USD 96.075.779
Anlagevolumen der Anteilklasse	USD 95.961.489
Nettoinventarwert	USD 126.124
Anzahl der Anteile	760.853
Fondswährung	USD
Währung der Anteilklasse	USD
ISIN	LU1965301184
Auflegedatum	01.08.2019
Replikationsmethode	Synthetisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0,30%

HANDELSINFORMATION

Annahmeschluss	16:00 Uhr (Luxemburger Zeit)
Mindestanlagesumme (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	USTP GY

ZUSAMMENSETZUNG DES INDEX* (%)



*Negative Gewichtung bedeutet, dass der Index eine Short-Position auf diesen Vermögenswert einnimmt. Von Ossiam berechnete Daten zum 31.05.2022. Quelle: Ossiam, Standard & Poor's

HISTORISCHE SPREADS ZWISCHEN DEN LANGFRISTIGEN¹ UND KURZFRISTIGEN² US-ZINSSÄTZEN



¹ Durchschnitt zwischen den US 30- und 10-Jahres-Zinssätzen.

² Durchschnitt zwischen den US 5- und 2-Jahres-Zinssätzen.

Von Ossiam berechnete Daten zum 31.05.2022. Quelle: Ossiam, 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.

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

„Das Finanzinstrument wird von der Solactive AG weder gesponsert noch beworben, verkauft oder auf sonstige Weise gefördert, und die Solactive AG gibt zu keiner Zeit eine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung im Hinblick auf die Ergebnisse einer Nutzung des Index und/oder der Indexmarke oder des Indexpreises oder in anderer Hinsicht. Der Index wird von der Solactive AG berechnet und veröffentlicht. Die Solactive AG bemüht sich, sicherzustellen, dass der Index richtig berechnet wird. Unabhängig von ihren Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten ist die Solactive AG nicht verpflichtet, Fehler im Index gegenüber Dritten anzuzeigen, insbesondere gegenüber Anlegern und/oder Finanzmittlern des Finanzinstruments. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung des Index oder der Indexmarke zur Nutzung in Verbindung mit dem Finanzinstrument stellen eine Empfehlung durch die Solactive AG zur Investition von Kapital in das entsprechende Finanzinstrument dar und sie stellen auch in keiner Weise eine Zusicherung oder Meinung der Solactive AG im Hinblick auf eine Investition in dieses Finanzinstrument dar.“

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.