

Stand: 30.08.2024

# OSSIAM EUROPE ESG MACHINE LEARNING UCITS ETF 1C (EUR)

## INVESTMENTSTRATEGIE

Anlageziel des Ossiam Europe ESG Machine Learning 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 nur zu Vergleichszwecken in Bezug auf Performance und CO<sub>2</sub>-Emissionen. Die Portfoliozusammensetzung des Fonds ist nicht durch die Benchmark beschränkt und kann erheblich von den in der Benchmark enthaltenen Komponenten abweichen.

Der Anlageprozess des Fonds ist systematisch. Zuerst werden mehrere ESG-Filter angewendet, um Unternehmen zu entfernen:

- Die in den umstrittenen Branchen Rüstungsgüter, Tabak oder Kohle tätig sind,
- Die schweren ESG-Kontroversen ausgesetzt sind,
- Die gegen eines der Prinzipien des UN Global Compact verstoßen
- Oder auf der Ausschlussliste der Norges Bank Investment Management stehen.

Die restlichen Bestände werden anschließend durch den Machine Learning-Algorithmus von Ossiam überprüft und anhand ihrer ESG-Profile als finanzielle Chancen oder Risiken klassifiziert. Das endgültige Portfolio besteht aus Aktien mit Wertsteigerungspotenzial, die entsprechend gewichtet sind, die Volatilität zu minimieren und die ESG-Ziele des Fonds zu erreichen.

Der ESG-Score des Portfolios strebt an, zehn Prozent über seiner Investmentuniversum, mit einem deutlich reduzierten CO<sub>2</sub>-Fußabdruck (40-prozentige Reduktion der gesamten Treibhausgasemissionen), einer geringeren CO<sub>2</sub>-Intensität (gesamte Treibhausgasemissionen/Unternehmenseinnahmen) und weniger Emissionen aus fossilen Brennstoffen.

### Wichtigste Vorteile:

- Nutzung von Machine Learning zur Identifizierung finanzieller Möglichkeiten aus ESG-Daten
- Erweitertes Risiko-Rendite-Profil
- Verbessertes ESG-Profil mit deutlicher Reduzierung der CO<sub>2</sub>-Bilanz

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



## (NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre ann. %	5 Jahre ann. %	Seit Auflage ann. %
Fonds	2,46	15,21	19,72	3,18	6,70	7,64
Investment Universum	1,49	11,97	17,46	6,21	9,13	7,97

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.08.2024. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

## RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität Ann. %	Apha Ann. %	Beta	Sharpe Ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	12,32	2,30	0,67	0,60	-31,00
Investment Universum	16,55	---	---	0,47	-35,36

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.08.2024. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

**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 frühere Wertentwicklung lässt nicht auf zukünftige Renditen schließen.**

**Risikohinweise:** Der Referenzwert soll nicht mit den ökologischen oder sozialen Ambitionen des Fonds in Einklang gebracht werden. Bitte beachten Sie, dass der Fonds neben dem allgemeinen Marktrisiko auch spezifischen Risiken wie dem Index-, Derivate- und Gegenparteierrisiken sowie den Risiken aus Schwellenländern ausgesetzt ist. Um mehr über die Risiken zu erfahren, lesen Sie bitte die Wesentlichen Anlegerinformation (KIID) und den Verkaufsprospekt vor einer Investition. Dieser Fonds fördert ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG), hat jedoch nicht das Ziel, nachhaltige Investitionen zu tätigen. Er kann teilweise in Vermögenswerten investieren, die ein nachhaltiges Ziel verfolgen, wie es beispielsweise in der EU-Klassifikation definiert ist.

\*Die Fonds wechselten von einem passiv gemanagten Index-Tracking-ETF zu einem aktiv gemanagten ETF-Fonds, der ESG-Merkmale fördert. Die Fonds geschaltet von Name, Index und Benchmark: Zuvor Ossiam iSTOXX® Europe Minimum Variance NR ist jetzt Ossiam Europe ESG Machine Learning ; Der Referenzindex (bzw. Benchmark ) war iSTOXX® Europe Minimum Variance NR (bzw. STOXX® Europe 600 Index) bis 22. Mai 2021 und ist jetzt Ossiam Europe ESG Machine Learning (bzw. Solactive Europe 600 Index NTR). Bitte beachten Sie, dass, wenn die Währung der Fonds/Aktienklasse von der Währung Ihrer Region abweicht, Verluste oder Gewinne, die von der Fonds/Aktienklasse generiert werden, durch Wechselkursschwankungen beeinflusst werden können (sowohl nach oben als auch nach unten).

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.

AUSSCHLIESSLICH FÜR IN DEN FONDS INVESTIERTE PROFESSIONELLE INVESTOREN ODER PRIVATANLEGER.

## RISIKOINDIKATOR



Die Anteilsklasse ist auf der synthetischen Risikoindikatorkala, die auf historischen Daten basiert, in die Kategorie 4 eingestuft. Aufgrund seines Engagements an den Aktienmärkten kann der Fonds eine erhebliche Volatilität verzeichnen, was sich in der Einstufung auf der obigen Skala niederschlagen 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. Sie könnten Ihre Investition ganz oder teilweise verlieren.

## INVESTMENT UNIVERSUM DATEN

Name	Solactive Europe 600 Index (EUR)
Bloomberg Ticker	EU600N Index
Auflagedatum	08.05.2006
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 8
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	EUR 58 402 457
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 19 182 285
Nettoinventarwert	EUR 255.321
Anzahl der Anteile	75 130
Fondswährung	EUR
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	LU0599612842
Auflagedatum	21.06.2011
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0.65%

## HANDELSINFORMATION

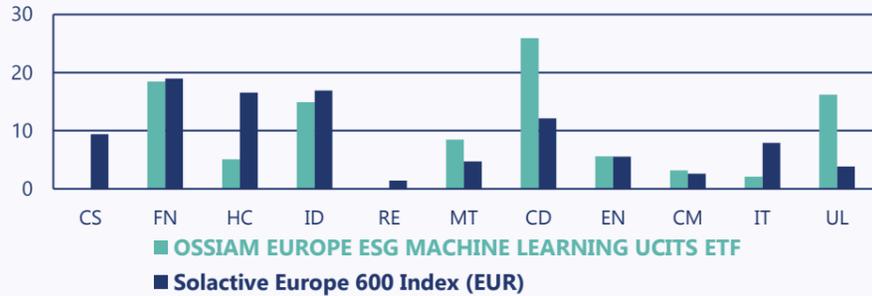
Annahmeschluss 15.00 Uhr (Luxemburger Zeit)

Mindestanlagesumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine Börse) 1 Anteil

Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten

London Exchange in EUR	EUMV LN
London Exchange in GBP	LEMV LN
XETRA in EUR	OSX4 GY
SIX Swiss Exchange in EUR	EUMV SW
Borsa Italiana in EUR	EUMV IM

## 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 30.08.2024. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

## TOP 10 POSITIONEN

	Ossiam Europe ESG Machine Learning UCITS ETF	Solactive Europe 600 Index
FERRARI NV	4.61%	0.54%
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	4.28%	0.50%
IBERDROLA SA	4.09%	0.69%
ESSILORLUXOTTICA SA	4.01%	0.57%
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA	3.98%	0.70%
SIEMENS AG	3.94%	1.17%
NORDEA BANK ABP	3.90%	0.32%
ENGIE SA	3.84%	0.26%
RELX PLC	3.76%	0.73%
NOKIA OYJ	3.16%	0.20%

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.08.2024. Quelle: Ossiam, Refinitiv.

## 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.

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.

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.

AUSSCHLIESSLICH FÜR IN DEN FONDS INVESTIERTE PROFESSIONELLE INVESTOREN ODER PRIVATANLEGER.

ossiam

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.

Einen Überblick über die Anlegerrechte in der Amtssprache Ihres Landes finden Sie auf der Website unter dem Abschnitt „rechtliche Informationen (im.natixis.com/intl/intl-fund-documents)

**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: Senckenberganlage 21, 60325 Frankfurt am Main.

**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.

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 sind berechtigt, die Vermarktung dieses Fonds nach Maßgabe der jeweils geltenden Rechtsvorschriften zu beenden