

Stand: 30.06.2025

Ossiam US Equity Factors Screened UCITS ETF - 1A (EUR)

INVESTMENTSTRATEGIE

Der Ossiam US Equity Factors Screened UCITS ETF zielt darauf ab, die Netto-Gesamtrendite einer Auswahl von börsennotierten US-Aktien nachzubilden, welche auf Basis ihrer ESG-Merkmale (Environment, Social, Governance) und ihres Exposures gegenüber Aktienfaktoren (Momentum, Size, Value und Volatility) bewertet werden.

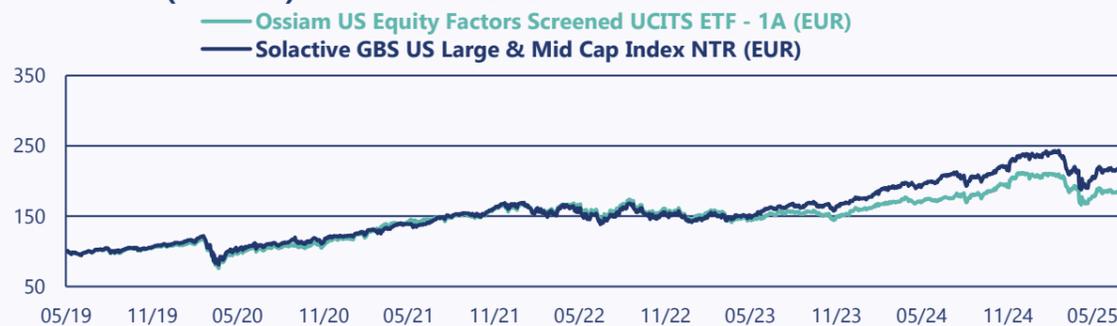
Der Anlageprozess des Fonds ist systematisch. Zuerst werden 80% der nach ESG-Kriterien am besten bewerteten Aktien ausgewählt, die dann wiederum gefiltert werden, um Unternehmen auszuschließen, die gegen einen vordefinierten Kriterienkatalog verstoßen.

Aus dem Aktienpool werden dann zwei unterschiedliche Portfolios gebildet, die im finalen Portfolio letztlich gleich gewichtet werden: ein Aktienfaktor-Portfolio und ein Sektorfaktor-Portfolio. Lediglich Aktien mit dem höchsten Exposure gegenüber den oben genannten Faktoren gelangen in das Aktienfaktor-Portfolio und werden entsprechend ihres Exposure gegenüber diesen Faktoren gewichtet, während gleichzeitig ein CO2-Fußabdruck von unter 40% im Vergleich zur Benchmark angestrebt wird. Für das Sektorenfaktor-Portfolio berücksichtigt die Strategie nur Value- und Momentum-Faktoren. Die Gewichtungen der Sektoren werden entsprechend der Signifikanz ihres Exposure gegenüber beiden Faktoren im Vergleich zur Benchmark nach oben oder unten angepasst. Die Aktien im Sektorenfaktor-Portfolio werden ebenfalls gewichtet, um den CO2-Fußabdruck des finalen Portfolios um 40% gegenüber der Benchmark zu reduzieren.

Wichtigste Vorteile:

- Exposure in Bezug auf eine Auswahl von US-Aktien
- Nutzung etablierter Aktienfaktoren, um beständige, nachhaltige und langfristige performance bei kontrolliertem Tracking Error zu erzielen
- Anwendung einer dynamischen Gewichtungsmethode basierend auf vier Faktoren (Momentum, Size, Value und Volatility)
- Verbesserung des ESG-Profiles mit deutlicher Reduzierung der CO2-Bilanz

PRODUKT-(NETTO-)PERFORMANCE SEIT AUFLAGE DES FONDS



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre ann. %	5 Jahre ann. %	Seit Auflage ann. %
Fonds	-0,06	-10,03	5,40	7,58	12,29	10,54
Investment Universum	1,76	-6,12	5,48	15,18	15,07	13,59

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität Ann. %	Apha Ann. %	Beta	Sharpe Ratio	höchster Wertverlust %
Fonds	20,72	-2,01	0,92	0,46	-35,56
Investment Universum	21,43	---	---	0,58	-33,77

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

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: Bitte beachten Sie, dass der Fonds neben dem allgemeinen Marktrisiko auch spezifischen Risiken wie Risiken im Zusammenhang mit ESG-Investments sowie geografischer Konzentration ausgesetzt ist. Um mehr über die Risiken zu erfahren, lesen Sie bitte die Wesentlichen Anlegerinformation (KID) und den Verkaufsprospekt vor einer Investition. Der Referenzwert soll nicht mit den ökologischen oder sozialen Ambitionen des Fonds in Einklang gebracht werden. Dieser Fonds fördert ökologische, soziale und Governance-Kriterien (ESG), hat jedoch nicht das Ziel, nachhaltige Investitionen zu tätigen. Er kann teilweise in Vermögenswerte investieren, die ein nachhaltiges Ziel verfolgen, wie es beispielsweise in der EU-Klassifikation definiert ist. Diese in EUR denominierte Anteilsklasse ist nicht gegen Währungsschwankungen abgesichert.

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



Wir haben den Fonds in die Risikoklasse 5 eingestuft, bei der es sich um eine mittelhohe Risikoklasse handelt. Mit anderen Worten: Die potenziellen Verluste im Zusammenhang mit den künftigen Ergebnissen des Produkts liegen auf einem mittleren hohen Niveau, und wenn sich die Situation auf den Märkten verschlechtert, ist es möglich, dass unsere Zahlungsfähigkeit Sie wahrscheinlich beeinträchtigt. Das Marktliquiditätsrisiko könnte die Schwankung der Produktperformance verstärken. Neben den im Risikoindikator enthaltenen Risiken können auch andere Risiken die Wertentwicklung des Fonds beeinflussen. Siehe Prospekt des Fonds.

INVESTMENT UNIVERSUM DATEN

Name	Solactive GBS US Large & Mid Cap Index NTR (USD)
Bloomberg Ticker	SUSLMCN Index
Auflagedatum	08.05.2017
Anlageklasse	Aktien
Häufigkeit der Neugewichtung	Quartalsweise

FONDSDATEN

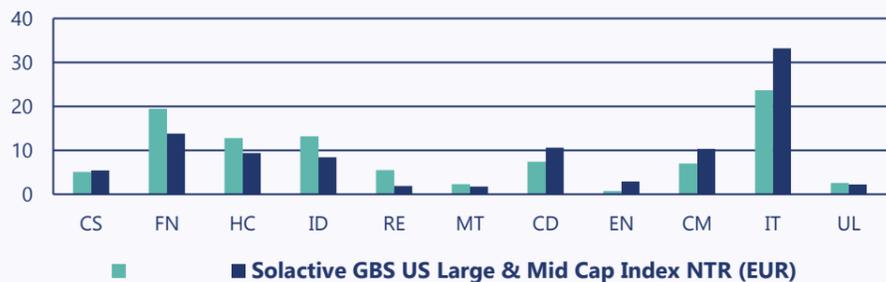
Depotbank	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Rechtsform	Teilfonds des Ossiam IRL ICAV
UCITS	Ja
Classification SFDR	Article 8
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Dividenden	Reinvestiert
Anlagevolumen des Fonds	USD 27 628 940
Anlagevolumen der Anteilsklasse	EUR 3 219 095
Nettoinventarwert	EUR 185.496
Anzahl der Anteile	17 354
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	EUR
ISIN	IE00BJBLDK52
Auflagedatum	02.05.2019
Replikationsmethode	Physisch
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0.45%

HANDELSINFORMATION

Annahmeschluss	15.00 Uhr (irische 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	OUFE GY
Borsa Italiana in EUR	OUFE 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 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

TOP 10 POSITIONEN

	Ossiam US ESG Low Carbon Equity Factors UCITS ETF	Solactive GBS US Large & Mid Cap Index NTR
NVIDIA CORP	4.59%	7.14%
MICROSOFT CORP	4.54%	6.98%
ALPHABET INC	2.45%	1.74%
BROADCOM INC	1.53%	2.43%
GEN DIGITAL INC	1.24%	0.03%
F5 INC	1.03%	---
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1.03%	---
ZILLOW GROUP INC	0.90%	---
JOHNSON & JOHNSON	0.89%	0.70%
ELI LILLY & CO	0.85%	1.26%

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Solactive AG, Trucost and Sustainalytics.

KONTAKT / INFO

www.ossiam.com
 mail: info@ossiam.com
 Tel: +33 1 84 79 42 70
 36 rue Brunel
 75017 PARIS - FRANCE

Dies ist eine Marketingmitteilung. Bitte lesen Sie den Prospekt des OGAW und das KIID/KID, das kostenlos unter www.ossiam.com erhältlich ist, bevor Sie endgültige Anlageentscheidungen treffen.

Ossiam IRL ICAV ("ICAV") ist ein Umbrella-Fonds, der als offene Investmentgesellschaft nach irischem Recht mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds gegründet und von der irischen Zentralbank unter der Nummer C173953 zugelassen ist. ICAV hat Ossiam zu seiner Verwaltungsgesellschaft ernannt, die für die Finanzverwaltung der Fonds sowie für die Verwaltung und den Vertrieb von ICAV verantwortlich ist. Ossiam, eine Tochtergesellschaft von Natixis Investment Managers, ist von der Autorité des Marchés Financiers als Portfolioverwaltungsgesellschaft unter der Nummer GP-10000016 zugelassen. Für die Richtigkeit, Vollständigkeit und Angemessenheit der Informationen aus externen Quellen wird keine Gewähr übernommen, obwohl diese aus zuverlässigen und seriösen Quellen zusammengestellt wurden. Wenn dieses Dokument im Vereinigten Königreich bereitgestellt wird, wird es nur zu Informationszwecken an professionelle Kunden oder geeignete Gegenparteien im Sinne des FCA-Handbuchs weitergegeben und darf von keiner anderen Person als Grundlage für die Weitergabe verwendet werden.

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

Das KID 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, beworben, verkauft oder auf andere Weise unterstützt, noch bietet die Solactive AG eine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung hinsichtlich der Ergebnisse der Nutzung des Index und/oder der Indexmarke oder des Indexpreises jederzeit oder in sonstiger Hinsicht. Der Index wird von der Solactive AG berechnet und veröffentlicht. Die Solactive AG bemüht sich nach besten Kräften, sicherzustellen, dass der Index korrekt berechnet wird. Unabhängig von ihren Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten besteht für die Solactive AG keine Verpflichtung, Dritte, insbesondere Anleger und/oder Finanzintermediäre des Finanzinstruments, auf Fehler im Index hinzuweisen. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung des Index oder der Indexmarke zum Zweck der Nutzung im Zusammenhang mit dem Finanzinstrument stellen eine Empfehlung der Solactive AG dar, Kapital in das Finanzinstrument zu investieren, noch stellen sie in irgendeiner Weise eine Zusicherung dar oder Meinung der Solactive AG im Hinblick auf eine Investition in dieses Finanzinstrument.

Der Zugang zu den in diesem Dokument beschriebenen Produkten und Dienstleistungen kann für bestimmte Personen oder in bestimmten Ländern Einschränkungen unterliegen. Keines der hier vorgestellten Produkte oder Dienstleistungen wird von Ossiam an Personen bereitgestellt, die nicht gesetzlich dazu berechtigt sind. Gleiches gilt für Länder, für die Ossiam keinen Zulassungsantrag gestellt hat.

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.

Bitte lesen Sie den Verkaufsprospekt und die wesentlichen Informationen sorgfältig, bevor Sie investieren. Wenn der Fonds in Ihrem Land registriert ist, sind diese Dokumente auch auf der Website von Natixis Investment Managers (im.natixis.com/intl/intl-fund-documents) kostenlos und in der Amtssprache des Landes, in dem der Fonds registriert ist, erhältlich.

Eine Zusammenfassung der Anlegerrechte in der Amtssprache Ihres Landes finden Sie in der Rubrik "Rechtliche Dokumentation" auf der Website (im.natixis.com/intl/intl-fund-documents).

In Deutschland und Österreich: Dieses Material wird von Natixis Investment Managers International oder ihrer Zweigniederlassung Natixis Investment Managers International, Zweigniederlassung Deutschland, bereitgestellt. Natixis Investment Managers International ist eine Portfoliomanagement Gesellschaft, die von der französischen Finanzaufsichtsbehörde AMF (Autorité des Marchés Financiers) unter der Nr. GP 90-009 zugelassen ist, und eine Aktiengesellschaft (société anonyme), die im Pariser Handels- und Gesellschaftsregister unter der Nr. 329 450 738 eingetragen ist. Eingetragener Sitz: 43 avenue Pierre Mendès France, 75013 Paris. Eingetragener Sitz von Natixis Investment Managers International, Zweigniederlassung Deutschland (Handelsregisternummer: HRB 129507) ist: Senckenberganlage 21, 60325 Frankfurt am Main.

Die oben erwähnten Gesellschaften sind Geschäftsentwicklungseinheiten von Natixis Investment Managers, einer Holdinggesellschaft mit einem breit gefächerten Angebot spezialisierter Vermögensverwaltungseinheiten und Distributionsgesellschaften weltweit. Die Vermögensverwaltungstochtergesellschaften von 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 für alle Investoren in allen Jurisdiktionen zugänglich.

Obwohl Natixis Investment Managers die in diesem Material 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 Material 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 -prozesse, auf die hier Bezug genommen wird, stellen die Ansichten der jeweiligen Person(en) zum angegebenen Datum dar. Diese sowie die dargestellten Portfoliobestände und -eigenschaften können sich ändern und sind nicht als vertraglich bindend zu betrachten. Es kann nicht zugesichert werden, dass die Entwicklungen so eintreten, wie sie in diesem Material prognostiziert werden. Die von externen Dritten geäußerten Analysen und Meinungen sind unabhängig und spiegeln nicht unbedingt die von Natixis Investment Managers wider.

Informationen über die Wertentwicklung in der Vergangenheit sind kein Hinweis auf die zukünftige Wertentwicklung.

Dieses Material darf nicht als solches, 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 kann beschließen, die Vertriebsvereinbarungen für diesen Fonds in Übereinstimmung mit den einschlägigen Rechtsvorschriften zu beenden.

