MARKETING-KOMMUNIKATION

Stand: 30.06.2025

OSSIAM US STEEPENER 2C (USD)

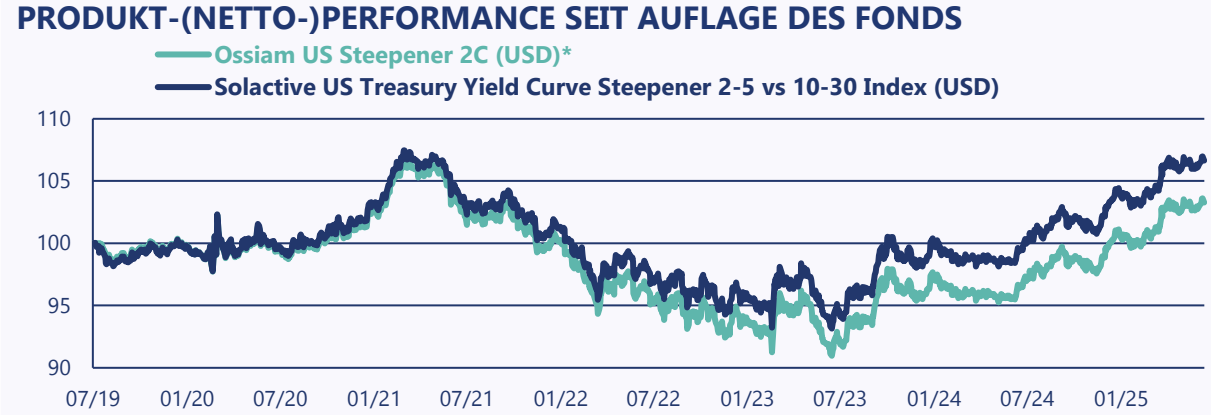
INVESTMENTSTRATEGIE

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



Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre ann. %	5 Jahre ann. %	Seit Auflage ann. %
Fonds	0.10	3.06	7.48	2.25	0.74	0.60
Index	0.09	3.02	7.68	2.77	1.27	1.09
Investment Universum	0.37	2.20	4.86	4.77	2.91	2.64

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität Ann. %	1-Jahr Tracking Error %	Ratio de Sharpe	höchster Wertverlust %
Fonds	4.93	0.10	-0.42	-14.53
Index	4.94	---	-0.32	-13.32
Investment Universum	0.20	---	---	0.00

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

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 Investionsbetrag 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 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 (KID) und den Verkaufsprospekt vor einer Investition.
*Da der Fonds am 2. August 2019 aufgelegt wurde, ist die Performance des Fonds vor diesem Datum flach.
Dieser Fonds fördert Umwelt- oder Sozial- und Governance-Kriterien (ESG), strebt jedoch keine nachhaltige Anlage an. Er kann teilweise in Vermögenswerte investieren, die ein nachhaltiges Ziel verfolgen, z.B. wie in der EU-Klassifizierung definiert.
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.

RISIKOINDIKATOR

GERINGERES RISIKO — HÖHERES RISIKO

1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7

Wir haben den Fonds in die Risikoklasse 2 eingestuft, bei der es sich um eine Risikoklasse mit geringem Risiko handelt. Mit anderen Worten: Die potenziellen Verluste im Zusammenhang mit den künftigen Ergebnissen des Produkts sind auf einem niedrigen Niveau, und wenn sich die Situation auf den Märkten verschlechtert, ist es möglich, dass unsere Zahlungsfähigkeit sehr unwahrscheinlich ist. Das Marktliquiditätsrisiko könnte die Schwankung der Produktperformance verstärken.

INDEXDATEN

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

FONDSDATEN

Depotbank	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Rechtsform	Teilfonds des Ossiam Lux SICAV
UCITS	Ja
Classification SFDR	Article 8
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Anlagevolumen des Fonds	USD 33 896 422
Anlagevolumen der Anteilsk	USD 1 138 662
Nettoinventarwert	USD 133.724
Anzahl der Anteile	8 515
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	USD
ISIN	LU1991353761
Auflagedatum	19.07.2019
Replikationsmethode	Synthetic
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0.30%

HANDELSINFORMATION

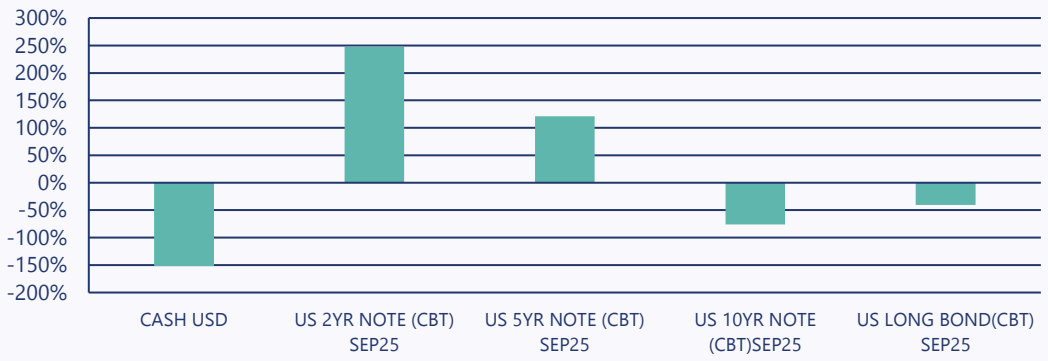
Annahmeschluss	16:00 Uhr (Luxemburger Zeit)
Mindestanlagesumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine	1 Anteil

Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten

BLOOMBERG in USD	STEEPNE LX
WKN in USD	A2PKUL

AUSSCHLIESSLICH FÜR IN DEN FONDS INVESTIERTE PROFESSIONELLE INVESTOREN ODER PRIVATANLEGER.

ZUSAMMENSETZUNG DES INDEX*



*Negative Gewichtung bedeutet, dass der Index eine Short-Position auf diesen Vermögenswert einnimmt.

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

HISTORISCHE SPREADS ZWISCHEN DEN LANGFRISTIGEN[1] UND KURZFRISTIGEN[2] US-ZINSSÄTZEN

[1] Durschnitt zwischen den US 30- und 10-Jahres-Zinssätzen.
[2] Durschnitt zwischen den US 5- und 2-Jahres-Zinssätzen.

Von Ossiam berechnete Daten zum 30.06.2025. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

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 Lux (die SICAV) besteht aus mehreren separaten Teilfonds (die jeweils einen „Fonds" bilden). Die SICAV hat das Visum der Aufsichtskommission des Finanzsektors des Großherzogtums Luxemburg erhalten. Die SICAV hat Ossiam zu ihrer Verwaltungsgesellschaft ernannt, die für die Finanzverwaltung der Fonds, die Verwaltung und den Vertrieb der SICAV verantwortlich ist. Die Verwaltungsgesellschaft hat die State Street Bank International GmbH, Niederlassung Luxemburg, zur Verwaltungsstelle, Zahlstelle, Domizilstelle und Gesellschaftsstelle sowie zur Register- und Transferstelle der SICAV ernannt. Ossiam, eine Tochtergesellschaft von Natixis Investment Managers, ist von der Autorité des Marchés Financiers unter der Nummer GP-10000016 als Portfolioverwaltungsgesellschaft 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.
Für Anleger in der Schweiz: Der Vertreter und Zahlungsagent für Fonds in der Schweiz ist CACEIS Investor Services Bank S.A.. Esch-sur-Alzette, Tochtergesellschaft von Zürich. Bleicherweg 7, CH-8027 Zürich. Das KID/KIID auf Englisch, außerdem der Prospekt auf Englisch, ist kostenlos auf unserer Website www.ossiam.com verfügbar.
ESG-Investitionen - Methodische Grenzen: Durch die Verwendung von ESG-Kriterien in der Anlagepolitik würde der betreffende Fonds unter anderem das Ziel verfolgen, das Nachhaltigkeitsrisiko besser zu managen. ESG-Kriterien können mithilfe von Ossiam-eigenen Modellen, Modellen und Daten von Dritten oder einer Kombination aus beiden generiert werden. Die Bewertungskriterien können sich im Laufe der Zeit ändern oder je nach Sektor oder Branche, in dem der betreffende Emittent tätig ist, variieren. Die Anwendung von ESG-Kriterien auf den Anlageprozess kann dazu führen, dass Ossiam aus nicht-finanziellen Gründen in Wertpapiere investiert oder diese ausschließt, unabhängig von den verfügbaren Marktchancen. Die von Dritten erhaltenen ESG-Daten können von Zeit zu Zeit unvollständig, ungenau oder nicht verfügbar sein. Daher besteht das Risiko, dass Ossiam ein Wertpapier oder einen Emittenten falsch bewertet, was zur Folge hat, dass ein Wertpapier direkt oder indirekt falsch in das Portfolio eines Fonds aufgenommen oder ausgeschlossen wird.
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 nicht gesponsert, beworben, verkauft oder anderweitig unterstützt und die Solactive AG bietet keine ausdrückliche oder stillschweigende Garantie oder Zusicherung hinsichtlich der Ergebnisse der Nutzung des Index und/oder der Marke des Index oder des Indexpreises. jederzeit oder in sonstiger Hinsicht. Der Index wird von der Solactive AG berechnet und veröffentlicht. Die Solactive AG tut ihr Bestes, um sicherzustellen, dass der Index korrekt berechnet wird. Unabhängig von ihren Verpflichtungen gegenüber dem Emittenten besteht für die Solactive AG keine Verpflichtung, im Index enthaltene Fehler an Dritte, einschließlich, aber nicht beschränkt auf Anleger und/oder Finanzintermediäre des Index, zu melden. Finanzinstrument. Weder die Veröffentlichung des Index durch die Solactive AG noch die Lizenzierung des Index oder der Indexmarke zur Nutzung im Zusammenhang mit dem Finanzinstrument stellen eine Empfehlung der Solactive AG dar, Kapital in das Finanzinstrument zu investieren, und stellen in keiner Weise eine Versicherung dar. oder die Meinung der Solactive AG bezüglich einer 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.

AUSSCHLIESSLICH FÜR IN DEN FONDS INVESTIERTE PROFESSIONELLE INVESTOREN ODER PRIVATANLEGER.

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.