MARKETING-KOMMUNIKATION

Stand: 27.03.2024

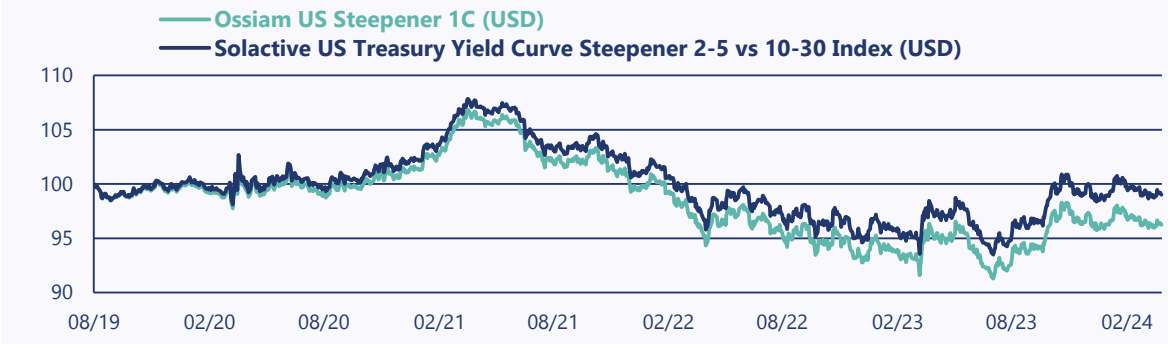
OSSIAM US STEEPENER 1C (USD)

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



Von Ossiam berechnete Daten zum 27.03.2024. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

(NETTO-)PERFORMANCE

	MTD PERF %	YTD PERF %	1 Jahr %	3 Jahre ann. %	5 Jahre ann. %	Seit Auflage ann. %
Fonds	-0.06	-0.05	0.46	-3.28	---	-0.82
Index	-0.02	0.09	1.15	-2.67	---	-0.21
Investment Universum	0.40	1.33	5.45	2.75	---	2.02

Von Ossiam berechnete Daten zum 27.03.2024. Quelle: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

RISIKOKENNZAHLEN SEIT AUFLAGE DES FONDS

	Volatilität Ann. %	Apha Ann. %	Beta	1-Jahr Tracking Error %	Ratio de Sharpe	höchster Wertverlust %
Fonds	5.19	---	---	0.09	-0.55	-14.54
Index	5.19	---	---	---	-0.43	-13.32
Investment Universum	0.18	---	---	---	---	0.00

Von Ossiam berechnete Daten zum 27.03.2024. 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.
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

Die Anteilsklasse ist auf der synthetischen Risikoindikatorskala, die auf historischen Daten basiert, in die Kategorie 2 eingestuft. Aufgrund seines Engagements an den Aktienmärkten kann der Fonds eine erhebliche Volatilität verzeichnen, was sich in der Einstufung auf der obigen Skala niedergeschlagen 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.

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 6
Deutsche Steuerkategorie	Transparent
Anlagevolumen des Fonds	USD 224 544 026
Anlagevolumen der Anteilsk	USD 151 180 105
Nettoinventarwert	USD 123.721
Anzahl der Anteile	1 221 946
Fondswährung	USD
Währung der Anteilsklasse	USD
ISIN	LU1965301184
Auflagedatum	01.08.2019
Replikationsmethode	Synthetic
Steuerliche Fondsklassifizierung in Deutschland ab 01.01.2018	Aktienfonds
Total Expense Ratio	0.30%

HANDELSINFORMATION

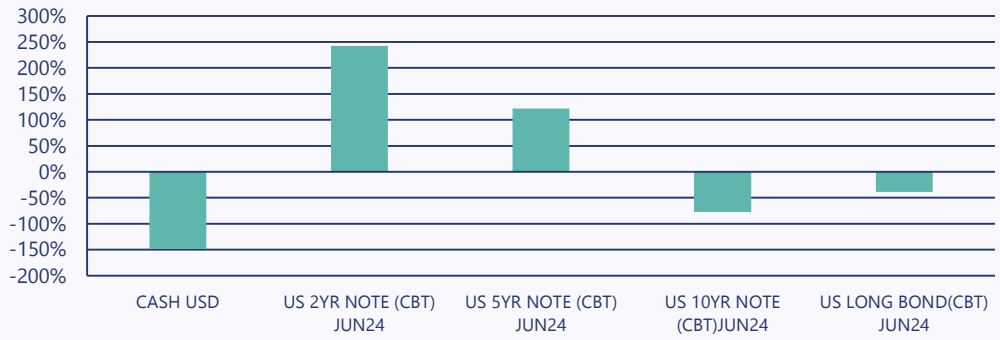
Annahmeschluss	16:00 Uhr (Luxemburger Zeit)
Mindestanlagesumme (bei Erwerb über den Sekundärmarkt bzw. über eine	1 Anteil

Zeichnung auf dem Primärmarkt nur autorisierten Teilnehmern und zugelassenen Investoren vorbehalten

XETRA in EUR	USTP GY

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 27.03.2024. 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 27.03.2024. 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.
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.
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.

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