

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

## OSSIAM EMERGING MARKETS ESG LOW CARBON (UCITS ETF 1C (EUR) ISIN: LU0705291903) ein Teilfonds von OSSIAM LUX SICAV

Verwaltungsgesellschaft: Ossiam, ein Unternehmen der Natixis-Gruppe

### Ziele und Anlagepolitik

#### Anlageziel

Anlageziel des Fonds ist die Erwirtschaftung der Nettogesamrendite einer Auswahl von in Schwellenländern notierten Aktien, wobei durchgehend ökologische, soziale und Unternehmensführungsangelegenheiten („ESG“) berücksichtigt werden.

Der Fonds wird aktiv verwaltet und verwendet seine Benchmark, den Solactive GBS Emerging Markets (die „Benchmark“) zur Vermögensallokation und zum Performancevergleich. Es ist vorgesehen, dass das Fondsportfolio zu einem erheblichen Anteil aus Komponenten der Benchmark bestehen wird. Die Gewichtungen des Portfolios können jedoch erheblich von den Gewichtungen der Benchmark abweichen.

#### Anlagepolitik

Zur Verfolgung seines Anlageziels wird der Fonds vorwiegend in alle oder einen Teil der Aktienwerte und Hinterlegungsscheine investieren, die unter Anwendung der nachfolgend beschriebenen Anlagestrategie ausgewählt werden. Alternativ dazu kann die Verwaltungsgesellschaft angemessene Ersatzwerte einschließlich unter anderem Hinterlegungsscheine, Futures oder mit Artikel 41(1)(e) des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils gültigen Fassung konforme OGA (bis zu 10 %) wählen.

Der Fonds wird zu mindestens 60 % in Aktien oder Rechte von Unternehmen investiert, die in Schwellenländern (einschließlich China und Russland) notiert sind. Der Fonds wird außerdem in Hinterlegungsscheine investieren.

Darüber hinaus kann der Fonds ergänzend andere Derivate zu Absicherungs- und Anlagezwecken einsetzen, wie im Prospekt unter „Einsatz von Derivaten sowie besonderer Anlage- und Sicherungstechniken“ beschrieben.

Die Referenzwährung des Fonds ist der US-Dollar.

#### Anlagestrategie

Das Anlageuniversum des Fonds besteht aus den Wertpapieren der Benchmark (das „Anlageuniversum“).

Zur Verfolgung ihres Anlageziels verwendet die Verwaltungsgesellschaft ihr eigenes quantitatives Modell, das einen regelbasierten Ansatz zur Bewertung der Wertpapiere aus dem Anlageuniversum anwendet.

Das Modell verwendet ESG-Daten, die von führenden Datenanbietern zur Verfügung gestellt werden, als Roheingabe für folgende Prozesse:

- zunächst zur Anwendung eines „normativen und Ausschlussfilters“, um Wertpapiere auszuschließen, die nicht mit den ESG- und Menschenrechtszielen des Fonds im Einklang stehen (z. B. Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact oder Gestand von äußerst riskanten Kontroversen),
- und dann für einen „Best-In-Class-Filter“, der in jedem Segment die 20 % Aktien mit den schlechtesten ESG-Ratings aus dem Anlageuniversum eliminiert.

Nur die liquidesten Wertpapiere, die die vorstehenden Filter bestehen, können zur Bildung des „zulässigen Universums“ ausgewählt werden.

Die Verwaltungsgesellschaft wendet danach ein Optimierungsverfahren zur Auswahl und Gewichtung von Wertpapieren an, um den Ausgleich zwischen der erwarteten Varianz und der risikobereinigten Performance des resultierenden Portfolios zu optimieren und gleichzeitig eine Reihe von Beschränkungen einzuhalten, einschließlich des Erhalts eines ESG-Ratings, das mindestens dem der Benchmark entspricht, und potenzieller THG-Emissionen, die um 50 % niedriger sind als die des Anlageuniversums.

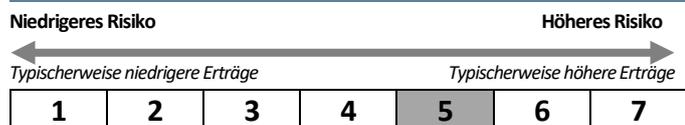
Unter bestimmten Marktbedingungen ist es eventuell nicht möglich, die Optimierung unter Einhaltung aller Beschränkungen vorzunehmen. Unter solchen Umständen kann die Verwaltungsgesellschaft einen Teil davon proportional reduzieren.

Eine detaillierte Beschreibung der Anlagestrategie (einschließlich der ESG-Strategie) finden Sie im Abschnitt „Anlagestrategie“ im entsprechenden Fondsanhang des Prospekts.

Die UCITS ETF 1C (EUR)-Anteile sind an mindestens einer Börse zum Handel notiert und Anleger können Anteile über ihren üblichen Broker an jedem Handelstag der entsprechenden Börse(n), der auch in Luxemburg ein Handelstag ist, oder über eine Fondsplattform kaufen oder verkaufen. Wenn Sie weitere Informationen wünschen, wenden Sie sich bitte an Ihren Broker. Die Anteilsklasse UCITS ETF 1C(EUR) ist eine thesaurierende Anteilsklasse, d.h. aus dem Fonds erzielte Erträge werden reinvestiert. Weitere Informationen finden Sie im Abschnitt „Zeichnung, Übertragung, Umtausch und Rücknahme von Anteilen“ sowie im Abschnitt „Praktische Informationen“ des Fondsanhangs im Prospekt.

Empfehlung: Dieser Fonds ist unter Umständen für Anleger nicht geeignet, die ihr Geld innerhalb eines Zeitraums von weniger als 5 Jahren aus dem Fonds wieder zurückziehen wollen.

### Risiko- und Ertragsprofil



Die Anteilsklasse ist auf der synthetischen Risiko- und Ertragsindikatorskala, die auf historischen Daten basiert, in die Kategorie 5 eingestuft. Aufgrund seines Engagements an den Aktienmärkten kann der Fonds eine erhebliche Volatilität verzeichnen, was sich in seiner 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.

Weitere Einzelheiten zu den Risiken entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Allgemeine Risiken“ im Verkaufsprospekt.

#### Spezielle Risikoerwägungen

**Marktrisiko:** Der Wert der Fondsanteile ist von börsennotierten Wertpapieren abhängig, deren Wert steigen oder fallen kann. Die Anleger sollten daher beachten, dass der Wert ihrer Anlage sowohl fallen als auch steigen kann, und sie sollten akzeptieren, dass es keine Garantie dafür gibt, dass die Strategie des Fonds in der Tat zu einer Rendite führt, die über einer vergleichbaren Anlagestrategie liegt, oder dass sie ihr ursprünglich investiertes Kapital zurückerhalten.

**Schwellenmarktrisiko:** Fonds, die in Schwellenmärkten investieren, können durch negative politische, wirtschaftliche, steuerliche oder aufsichtsrechtliche Entwicklungen erheblich beeinträchtigt werden. Schwellenländeranlagen bieten unter Umständen nicht denselben Grad an Anlegerschutz oder Anlegerinformation, der in der Regel an größeren Wertpapiermärkten gelten würde. Überdies können die Börsen in den Schwellenländern starken Schwankungen unterworfen sein. Schließlich sind Fonds unter Umständen nicht in der Lage, Wertpapiere in Schwellenländern schnell und leicht zu veräußern.

**Derivate- und Kontrahentenrisiko:** Fonds können börsennotierte und nicht börsennotierte Derivatekontrakte abschließen, um ein Engagement in den Basiswerten aufzubauen oder um ihre Direktanlagen abzusichern. Wertschwankungen der Basiswerte haben zur Folge, dass sich die Zahlungen im Rahmen dieser Kontrakte ändern. Durch die Kontrakte sind die Fonds unter Umständen einem höheren Marktrisiko ausgesetzt. Dies kann in einigen Fällen zu höheren Verlusten führen. Außerbörsliche Kontrakte werden mit einem spezifischen Kontrahenten vereinbart. Falls der Kontrahent in Liquidation geht oder seine Verpflichtungen im Rahmen des Kontrakts nicht erfüllt, kann der Fonds einen Verlust erleiden. Da sie nicht börsennotiert sind, kann der Preis dieser Kontrakte schwer zu bewerten sein.

**ESG-Risiko:** Es besteht das Risiko, dass sich ESG-Anlagen schlechter entwickeln als der Gesamtmarkt. ESG-Informationen von externen Datenanbietern können unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein. Daher besteht ein Risiko, dass die Verwaltungsgesellschaft ein Wertpapier oder einen Emittenten falsch beurteilt, so dass ein Wertpapier zu Unrecht in das Portfolio eines Fonds aufgenommen oder daraus ausgeschlossen wird.

## Kosten für diesen Fonds

Die von Ihnen getragenen Kosten werden für den Betrieb des Fonds verwendet, einschließlich der Vermarktung und des Vertriebs der Fondsanteile. Diese Kosten reduzieren das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage.

### Gebühren je Anteilklasse - UCITS ETF 1C (EUR)

#### Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

<b>Ausgabeaufschlag</b>	Maximaler Ausgabeaufschlag 3,00 % Maximale Gebühr für Zeichnungen, die an den Fonds zu zahlen ist 2,00 %
<b>Rücknahmeabschlag</b>	Maximaler Rücknahmeabschlag 3,00 % Maximale Gebühr für Rücknahmen, die an den Fonds zu zahlen ist 2,00 %

Dabei handelt es sich um den Höchstbetrag, der von Ihrer Anlage vor der Anlage oder vor der Auszahlung Ihrer Rendite abgezogen wird.

#### Kosten, die vom Fonds im Laufe des Jahres abgezogen werden

**Laufende Kosten:** 0,75 % p.a.

#### Kosten, die der Fonds unter bestimmten Umständen zu tragen hat

An die Wertentwicklung gebundene Gebühren: -

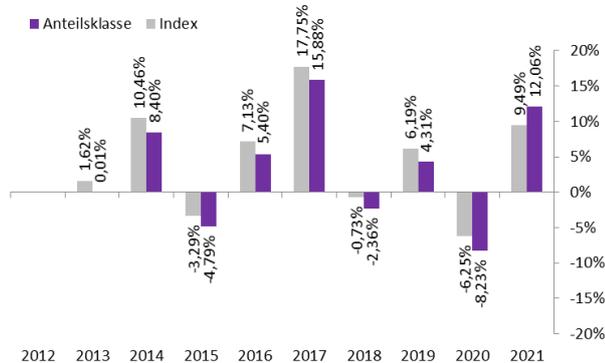
Bei den angegebenen **Ausgabeauf-** und **Rücknahmeabschlägen** handelt es sich um Höchstbeträge. In einigen Fällen zahlen Sie unter Umständen weniger. Ihr Finanzberater kann Ihnen hierzu nähere Informationen geben.

Falls ein Anleger einen exzessiven Handel betreibt oder Market-Timing praktiziert, kann von ihm eine zusätzliche Gebühr von bis zu 2,00% erhoben werden.

Die **laufenden Kosten** beziehen sich auf das am 31. Dezember 2021 abgelaufene Geschäftsjahr. Dieser Wert kann von Jahr zu Jahr schwanken. Er enthält keine Portfoliotransaktionskosten mit Ausnahme von Ausgabeaufschlägen/Rücknahmeabschlägen, die die SICAV beim Kauf oder Verkauf von Anteilen anderer Organismen für gemeinsame Anlagen zahlt.

**Weitere Informationen zu den Kosten finden Sie in den Kapiteln „Gebühren und Aufwendungen“ und „Zeichnung, Übertragung, Umtausch und Rücknahme von Anteilen“ im Fondsprospekt. Dieser ist über die Website [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com) abrufbar.**

### Wertentwicklung in der Vergangenheit



Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Hinweis auf die zukünftige Entwicklung.

**Dieses Balkendiagramm zeigt die Wertentwicklung der Anteilklasse UCITS ETF 1C (EUR) in ihrer Notierungswährung. Es berücksichtigt die laufenden Kosten, nicht jedoch die Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge.**

Datum der Auflegung des Fonds: 3. Februar 2012

Datum der Auflegung der Anteilklasse: 3. Februar 2012

Der Fonds war bis zum 26.08.2021 ein passiv verwalteter UCITS ETF, der den OSSIAM Emerging Markets Minimum Variance Index Net Return USD (der „Index“) nachbildet. Das nebenstehende Bardiagramm zeigt die Wertentwicklung des Fonds einerseits und des Index andererseits. Es spiegelt die Wertentwicklung der Benchmark (anstelle des Index) wider, wenn diese für den Zeitraum ab dem 27.08.2021 (wenn der Fonds aktiv verwaltet wird) verfügbar wird.

### Praktische Informationen

#### Verwahr- und Verwaltungsstelle des Fonds:

State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch  
49, avenue J.F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg

#### Verwaltungsgesellschaft:

Ossiam  
6, Place de la Madeleine  
75008 Paris, Frankreich

**Handelsfrist:** 16.00 Uhr (Luxemburger Zeit) am vorhergehenden Handelstag, wenn der Handelstag kein Freitag ist.  
10.15 Uhr (Luxemburger Zeit) am vorhergehenden Handelstag, wenn der Handelstag ein Freitag ist.

Der indikative Nettoinventarwert des Fonds kann unter [www.solactive.com](http://www.solactive.com) eingesehen werden. Die Informationen über das Fondsportfolio werden in den Jahres- und Halbjahresberichten des Fonds veröffentlicht.

**Weitere Informationen über die SICAV und den Fonds können kostenlos am Geschäftssitz der Verwaltungsgesellschaft oder der Verwahr- und Verwaltungsstelle angefordert werden auf Französisch und Englisch. Hierzu zählen die englischen Fassungen des Verkaufsprospekts, der Berichte und Abschlüsse der gesamten SICAV sowie Informationen zum Verfahren für den Umtausch von Anteilen zwischen Teilfonds. Der Anteilspreis des Fonds ist über [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com) abrufbar und kann auch am Geschäftssitz der Verwaltungsgesellschaft oder bei der Verwaltungsstelle angefordert werden.**

**Die aktuelle Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft einschließlich einer Beschreibung, wie Vergütungen und Vergünstigungen berechnet werden, kann unter [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com) abgerufen werden. Ein Druckexemplar wird auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.**

Die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds sind rechtlich voneinander getrennt. Die Rechte der Anleger und Gläubiger bezüglich eines Teilfonds sind daher auf die Vermögenswerte dieses Teilfonds begrenzt, sofern die Gründungsunterlagen der SICAV nichts anderes vorsehen.

Der Fonds unterliegt in Luxemburg unter Umständen einer speziellen steuerlichen Behandlung. Abhängig von dem Land, in dem Sie ansässig sind, könnte sich dies auf Ihre Anlage auswirken. Für weitere Informationen wenden Sie sich bitte an einen Berater. Der Fonds erfüllt die Anforderungen eines Aktienfonds gemäß dem deutschen Investmentsteuergesetz (InvStG), so wie im Prospekt im Abschnitt „Steuern“ näher beschrieben.

Anteilklasse	ISIN	Art der Anleger	Währung	Mindestzeichnungsa nforderungen	Mindestrücknahme anforderungen	Ausschüttungspo litik
UCITS ETF 1C (EUR)	LU0705291903	Alle Anleger*	EUR	2.000.000 EUR	2.000.000 EUR	Thesaurierung

\* Zeichnungen am Primärmarkt nur für autorisierte Teilnehmer und zugelassene Anleger.

Ossiam kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Fondsprospekts vereinbar ist.

Der Fonds ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die *Commission de Surveillance du Secteur Financier* (CSSF) reguliert.

Ossiam ist in Frankreich zugelassen und wird durch die *Autorité des Marchés Financiers* (AMF) reguliert.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 16 Februar 2022.