

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 STOXX® EUROPE 600 ESG EQUAL WEIGHT NR (UCITS ETF 1C (EUR) ISIN: LU0599613147), ein Teilfonds der OSSIAM LUX SICAV

Verwaltungsgesellschaft: Ossiam, ein Unternehmen der Natixis-Gruppe

### Ziele und Anlagepolitik

#### Anlageziel:

Anlageziel des OSSIAM STOXX® EUROPE 600 ESG EQUAL WEIGHT NR Fund (der „Fonds“) ist es, die Entwicklung des STOXX® EUROPE 600 ESG Broad Market Equal Weight Index Net Return EUR nachzubilden, der Wertpapiere anhand von bestimmten Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungskriterien (ESG) filtert. Die Nachbildung wird auf Basis des Indexschlusskurses und vor Abzug der Gebühren und Aufwendungen des Fonds angestrebt. Der Fonds wird passiv verwaltet.

Der STOXX® EUROPE 600 ESG EQUAL WEIGHT Index Net Return EUR (der „Index“) ist ein in EUR ausgedrückter Total Return Index (mit Wiederanlage der Nettodividenden), der von STOXX (der „Indexanbieter“) berechnet und veröffentlicht wird.

Der Index ist die gleichgewichtete Version des STOXX® Europe 600 ESG Broad Market Index (der „Basisindex“), der wiederum die ESG-Version des weit verbreiteten STOXX® Europe 600 Index (der „Hauptindex“) ist. Der Index hat die gleichen Bestandteile wie der Basisindex (unter normalen Umständen zusammengesetzt aus 80 % der Anzahl der Wertpapiere des Hauptindex), und jedem Unternehmen im Index wird das gleiche Gewicht zugeteilt (unter normalen Umständen 1/480 oder 0,2083 %), wobei eine vierteljährliche Neugewichtung erfolgt. Daher weichen die Sektorengagements im Index von denen des Basis- und Hauptindex ab.

Eine ausführliche Beschreibung des Indexes finden Sie im Abschnitt „Beschreibung des Indexes“ im Fondsanhang des Prospekts.

#### Anlagepolitik:

Zur Verfolgung seines Anlageziels verwendet der Fonds in erster Linie Indexswaps, die ihm durch synthetische Replikation ein Engagement im Index ermöglichen sollen. Dabei investiert der Fonds in ein Portfolio aus Vermögenswerten, dessen Performance im Rahmen einer Swap-Vereinbarung mit einem Swap-Kontrahenten gegen die Performance des Index getauscht wird. Diese Methode beinhaltet ein Kontrahentenrisiko, wie im Risiko- und Ertragsprofil beschrieben. Der Nettoinventarwert je Anteil des Fonds wird daher entsprechend der Entwicklung des Indexes steigen (oder fallen). Der Kontrahent des Swaps ist ein erstklassiges Finanzinstitut, das auf diese Art von Geschäften spezialisiert ist.

Der Fonds kann auch mehrere Swap-Vereinbarungen mit mehreren Swap-Kontrahenten abschließen, die ebenfalls die vorstehend beschriebenen Merkmale aufweisen.

Alternativ dazu kann der Fonds in alle oder einen Teil der im Index enthaltenen Aktien investieren.

Der Fonds kann unter Berücksichtigung der besten Interessen seiner Anteilsinhaber beschließen, ganz oder teilweise von einer der oben beschriebenen Strategien auf die andere überzugehen (d.h. synthetische Nachbildung vs. physische Nachbildung).

In beiden Replikationsstrategien ist das Fondsvermögen stets zu mindestens 75 % in Aktien oder Rechte investiert, die von Unternehmen mit Geschäftssitz im Europäischen Wirtschaftsraum, ausgenommen Liechtenstein, emittiert wurden.

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

Die Referenzwährung des Fonds ist der Euro.

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 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

Niedrigeres Risiko

Höheres Risiko

← Typischerweise niedrigere Erträge      Typischerweise höhere Erträge →

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Die Anteilsklasse ist auf der synthetischen Risiko- und Ertragsindikatorskala, die auf historischen Daten basiert, in die Kategorie 6 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.

#### Spezielle Risikoerwägungen

##### Indexrisiko:

Der Wert der Fondsanteile ist vom Index abhängig, dessen 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 zugrunde liegende Methodik des Indexes in der Tat zu einer Rendite führt, die über einer vergleichbaren Anlagestrategie liegt, oder dass sie ihr ursprünglich investiertes Kapital zurückerhalten.

#### Derivate- und Kontrahentenrisiko:

Durch den Abschluss von Swapgeschäften unterliegt der Fonds einem potenziellen Kontrahenten- und Emittentenrisiko. Im Falle der Insolvenz oder des Ausfalls des Kontrahenten oder des Emittenten könnte der Fonds einen Verlust erleiden.

Der Wert der Swap-Transaktion(en) kann in Abhängigkeit von verschiedenen Faktoren schwanken, wie z. B. unter anderem dem Indexstand, den Zinssätzen und der Liquidität des Aktienmarktes.

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

#### ESG-Risiko

Es besteht das Risiko, dass sich ESG-Anlagen schlechter entwickeln als der Gesamtmarkt. ESG-Informationen können unvollständig, unrichtig oder nicht verfügbar sein. Daher besteht das Risiko, dass der Indexanbieter ein Wertpapier oder einen Emittenten falsch beurteilt, so dass ein Wertpapier zu Unrecht in den Index aufgenommen oder daraus ausgeschlossen wird.

## Kosten für diese Anteilsklasse

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.

### Kosten je Anteilsklasse - Anteilsklasse UCITS ETF 1C (EUR)

#### Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

<b>Ausgabeaufschlag</b>	Maximaler Ausgabeaufschlag 3,00 % Maximale Replikationsgebühr bei Zeichnungen 1,00 %
<b>Rücknahmeabschlag</b>	Maximaler Rücknahmeabschlag 3,00 % Maximale Replikationsgebühr bei Rücknahmen 1,00 %

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

#### Kosten, die von der Anteilsklasse im Laufe des Jahres abgezogen werden

**Laufende Kosten:** 0,35 % p.a.

#### Kosten, die die Anteilsklasse unter bestimmten Umständen zu tragen hat

**An die Wertentwicklung gebundene Gebühren:** -

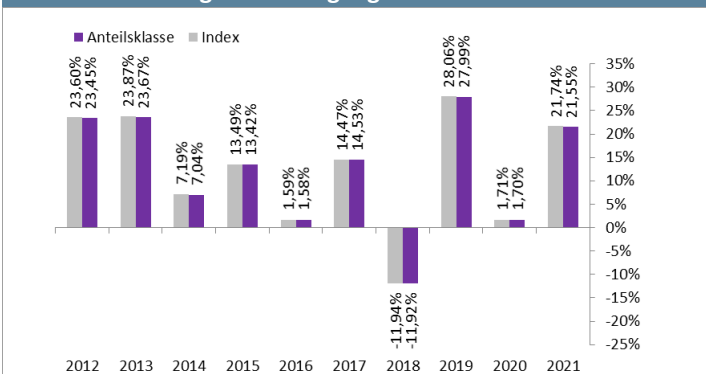
Bei den angegebenen **Ausgabeauf-** und **Rücknahmeabschlägen** handelt es sich um Höchstbeträge. In einigen Fällen zahlen Sie unter Umständen weniger. Ihr Finanzberater kann Ihnen hierzu nähere Informationen geben.

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.

**Der Index in diesem Balkendiagramm dargestellte ist der STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index net Return EUR, der am 24. Januar 2022 durch den oben unter Ziel und Anlagepolitik genannten Index ersetzt wurde.**

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

Datum der Auflegung des Fonds: 16. Mai 2011

Datum der Auflegung der Anteilsklasse: 16. Mai 2011

## Praktische Informationen

### Verwahr- und Verwaltungsstelle des Fonds:

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

### Verwaltungsgesellschaft:

Ossiam  
6, place de la Madeleine  
75008 Paris, France

### Handelsfrist: 15.30 Uhr (Luxemburger Zeit)

Der indikative Nettoinventarwert des Fonds kann unter [www.euronext.com](http://www.euronext.com) abgerufen 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. Hierzu zählen die englische und französische 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. Dieser Fonds erfüllt die Voraussetzungen für den französischen Sparplan PEA für französische Anleger. 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.

Anteilsklasse	ISIN	Art der Anleger	Währung	Mindestzeichnungsanforderungen	Mindestrücknahmeanforderungen	Ausschüttungspolitik
UCITS ETF 1C (EUR)	LU0599613147	Alle Anleger*	Euro	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 STOXX® EUROPE 600 ESG Broad Market Equal Weight Index ist das geistige Eigentum (einschließlich eingetragener Marken) der STOXX Ltd., Zug, Schweiz („STOXX“), der Deutsche Börse Gruppe oder deren Lizenzgeber, und wird im Rahmen einer Lizenz genutzt. Der OSSIAM STOXX® EUROPE 600 ESG EQUAL WEIGHT NR Fund wird von STOXX, der Deutsche Börse Gruppe oder deren Lizenzgebern, Research-Partnern oder Datenanbietern weder gesponsert noch gefördert, vertrieben oder in sonstiger Weise unterstützt, STOXX, die Deutsche Börse Gruppe und ihre Lizenzgeber, Forschungspartner oder Datenanbieter geben keine Garantie und schließen jegliche Haftung (aufgrund von Fahrlässigkeit oder auf sonstiger Grundlage) in Bezug auf Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen im STOXX® EUROPE 600 ESG Broad Market Equal Weight Index oder seinen Daten aus.

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.

