

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.

## BARCLAYS QUANTIC GLOBAL E NR (UCITS ETF 1C (EUR) ISIN: LU2491211004), ein Teilfonds der OSSIAM LUX SICAV

Verwaltungsgesellschaft: Ossiam, ein Unternehmen der Natixis-Gruppe

### Ziele und Anlagepolitik

#### Anlageziel:

Das Anlageziel des Barclays Quantic Global E NR Fund (der „Fonds“) besteht darin, die Wertentwicklung des Barclays Quantic Global E Index (der „Index“, Ticker: BXIIQUAE) vor Abzug der Gebühren und Aufwendungen des Fonds nachzubilden.

Der Index wird in Euro (EUR) ausgedrückt und von der Solactive AG berechnet. Der Index wird von Barclays Bank PLC veröffentlicht.

Der Index investiert in Aktien aus Industrieländern, die auf der Grundlage der höchsten fundamentalen Bewertungen von Quantic ausgewählt werden und Mindestliquiditätskriterien unterliegen. Der Index schließt dann Aktien aus, die kein Umweltrisikoring von Sustainalytics haben, in umstrittene Geschäfte verwickelt sind, den Global Compact der Vereinten Nationen nicht einhalten oder unter den untersten 50 % in der Rangliste des Umweltrisikoring-Ratings innerhalb der jeweiligen Branche sind.

Jeden zweiten Monat wählt der Index die Aktien mit den besten Signalen von Quantic aus und investiert 50 von 70 des gleichgewichteten Korbs (ca. 70 %) in Nordamerika und 20 (ca. 30 %) in anderen Ländern.

Quantic verwendet sein Modell, um zweimonatlich Signale für die Berechnung des Index zu senden. Der Index ist vollständig regelbasiert.

Der nachgebildete Index versteht sich nach Abzug von Gebühren.

Das erwartete Niveau des Tracking Errors unter normalen Bedingungen liegt bei 1,00 % p. a.

Weitere Einzelheiten sind der „Indexmethodik“ des Fonds im Prospekt zu entnehmen.

#### Anlagepolitik:

Um sein Anlageziel zu erreichen, verwendet der Fonds eine Kombination von Swaps, die ihm durch synthetische Replikation die Nachbildung der Indexperformance ermöglichen sollen.

Dabei investiert der Fonds in ein Portfolio aus Vermögenswerten, dessen Performance bzw. Wert im Rahmen einer Kombination von Swap-Vereinbarungen mit einem Swap-Kontrahenten gegen die Performance bzw. den Wert des Index oder eines ähnlichen Index, oder eines Portfolios aus dessen Indexkomponenten, 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 der Swaps ist Barclays Bank Ireland PLC, ein erstklassiges Finanzinstitut, das auf diese Art von Geschäften spezialisiert ist. Die Verwaltungsgesellschaft hat keine förmliche Ausschreibung zur Auswahl dieser finanziellen Gegenpartei durchgeführt und wird dies auch nicht tun.

Der Fonds investiert in Beteiligungspapiere, Beteiligungsrechte und Hinterlegungsscheine, die die zulässigen Vermögenswerte darstellen.

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.

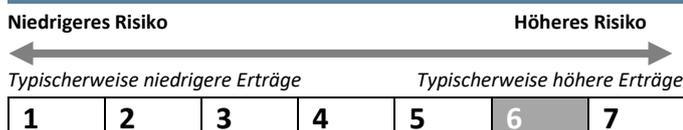
Die Referenzwährung des Fonds ist der Euro.

Die UCITS ETF 1C (EUR)-Anteile können von Anlegern nur über ihre üblichen Vermittler und zugelassene Teilnehmer an jedem Handelstag gezeichnet und zurückgegeben werden. Zusätzliche Informationen erhalten Sie von Ihrem Vermittler.

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 6 eingestuft. Aufgrund seines Engagements an den Aktienmärkten kann die Anteilsklasse eine erhebliche Volatilität verzeichnen, was sich in ihrer 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 der Anteilsklasse. 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.

#### ESG-Risiko

Es besteht das Risiko, dass sich ESG-Anlagen schlechter entwickeln als der Wert des Gesamtmarkts. 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.

#### Derivate- und Kontrahentenrisiko

Die Fonds können börsennotierte und nicht börsennotierte Derivatekontrakte abschließen, um ein Engagement in den Basiswerten aufzubauen oder um seine Direktanlagen abzusichern. Wertschwankungen der Basiswerte haben zur Folge, dass sich die Zahlungen im Rahmen dieser Kontrakte ändern. Durch diese Kontrakte kann sich das Marktrisiko der Fonds erhöhen, was in einigen Fällen zu höheren Verlusten führen kann.

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.

#### Geografisches Konzentrationsrisiko

Fonds, die ihre Anlagen auf bestimmte geografische Regionen konzentrieren, können Verluste erleiden. Dies gilt insbesondere dann, wenn die Volkswirtschaften dieser Regionen Schwierigkeiten haben oder wenn eine

Anlage in diesen Regionen an Attraktivität verliert. Zudem können die Märkte, in denen die Fonds investieren, durch negative politische, wirtschaftliche oder aufsichtsrechtliche Entwicklungen erheblich beeinträchtigt werden.

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

## 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

**Ausgabeaufschlag** Maximaler Ausgabeaufschlag 3,00 %  
Maximale Replikationsgebühr bei Zeichnungen, die an den Fonds zu zahlen ist 1,00 %

**Rücknahmeabschlag\*** Maximaler Rücknahmeabschlag 3,00 %  
Maximale Replikationsgebühr bei Rücknahmen, die an den Fonds zu zahlen ist 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:** 0,70 % p.a.

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

**An die Wertentwicklung gebundene Gebühren:** Keine

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 eine zusätzliche Gebühr von bis zu 2,00 % erhoben werden.

Die **laufenden Kosten** basieren auf prognostizierten Aufwendungen. 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

Es liegen keine ausreichenden Daten vor, um den Anlegern dieser Anteilsklasse sinnvolle Angaben zur früheren Wertentwicklung zu machen.

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

Datum der Auflegung des Fonds: Vom Verwaltungsrat festzulegen

Datum der Auflegung der Anteilsklasse: Vom Verwaltungsrat festzulegen

## Praktische Informationen

### Verwah- 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, Frankreich

**Handelsfrist:** 17.00 Uhr (Luxemburger Zeit) am vorhergehenden Handelstag

Die Informationen über das Fondsportfolio werden in den Jahres- und Halbjahresberichten des Fonds veröffentlicht. Ausführlichere Informationen finden Sie auch unter [www.bloomberg.com](http://www.bloomberg.com).

Weitere Informationen über die SICAV und den Fonds können kostenlos am Geschäftssitz der Verwaltungsgesellschaft oder der Verwah- und Verwaltungsstelle angefordert werden. Hierzu zählen die englischen und französischen 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.

Einzelheiten zur aktuellen Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft, einschließlich einer Beschreibung der Berechnung der Vergütungen und Leistungen, sind unter [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com) verfügbar. 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.

Anteilsklasse	ISIN	Art der Anleger	Währung	Mindestzeichnungsanforderungen	Mindestrücknahmeanforderungen	Ausschüttungspolitik
UCITS ETF 1C (EUR)	LU2491211004	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.

**Haftungsausschluss Quantic:** Die Quantic Financial Solutions GmbH ist nicht der Emittent oder Hersteller des „Barclays QUANTIC Global E“ Index und hat keine Verantwortung, Verpflichtungen oder Pflichten gegenüber den Anlegern des „Barclays QUANTIC Global E“ Index. Der „Barclays QUANTIC Global E“-Index wird von der Quantic Financial Solutions GmbH nicht gesponsert, unterstützt, verkauft oder beworben. Die Quantic Financial Solutions GmbH übernimmt keine Garantie für die Angemessenheit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit des „Barclays QUANTIC Global E“ Index oder der darin enthaltenen oder ihm zugrunde liegenden Daten oder Methoden. Quantic Financial Solutions GmbH haftet nicht für Fehler, Auslassungen oder Störungen und übernimmt keine ausdrücklichen oder impliziten Gewährleistungen in Bezug auf die Performance oder Ergebnisse, die eine Partei mit der Nutzung des „Barclays QUANTIC Global E“ Index und von darin enthaltenen Informationen oder von Informationen, auf denen diese basiert, erzielt, und sie schließt diesbezüglich ausdrücklich jegliche Gewährleistung der Marktfähigkeit oder Eignung zu einem bestimmten Zweck aus, und sie haftet nicht für Forderungen oder Verluste jeglicher Art in Verbindung mit der Nutzung des „Barclays QUANTIC Global E“ Index oder dieser Informationen einschließlich unter anderem von entgangenen Gewinnen, Folgeschäden oder Schadensersatz mit Strafcharakter.

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 13. Juni 2022.