

Ostrum Total Return Volatility I/A (EUR) / LU2373384218 / A3E20V / Natixis Inv. M. Int.

| Aktuell 10.09.2026 <sup>1</sup> | Region   | Branche       | Ausschüttungsart | Typ                  |
|---------------------------------|----------|---------------|------------------|----------------------|
| 75803,50 EUR                    | weltweit | AI Volatility | thesaurierend    | Alternative Investm. |



| Risikokennzahlen  |   |   |   |   |   |   |         |
|-------------------|---|---|---|---|---|---|---------|
| SRI               | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7       |
| Jahresperformance |   |   |   |   |   |   |         |
| 2025              |   |   |   |   |   |   | +2,16%  |
| 2024              |   |   |   |   |   |   | +6,51%  |
| 2023              |   |   |   |   |   |   | +10,94% |

Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

| Stammdaten                 |                             | Konditionen                       |       | Sonstige Kennzahlen                             |               |
|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------------|-------|-------------------------------------------------|---------------|
| Fondart                    | Einzelfond                  | Ausgabeaufschlag                  | 1,00% | Mindestveranlagung                              | EUR 50.000,00 |
| Kategorie                  | Alternative Investments     | Managementgebühr                  | 0,50% | Sparplan                                        | Nein          |
| Fondsunterkategorie        | AI Volatility               | Depotgebühr                       | -     | UCITS / OGAW                                    | Ja            |
| Ursprungsland              | Luxemburg                   | Tilgungsgebühr                    | 0,00% | Gewinnbeteiligung                               | 0,00%         |
| Tranchenvolumen            | (10.09.2026) EUR 9,45 Mio.  | Sonstige lfd. Kosten (20.03.2026) | 0,62% | Umschichtgebühr                                 | -             |
| Gesamt-Fondsvolumen        | (10.09.2026) EUR 54,68 Mio. | Transaktionskosten                | 0,07% | Fondsgesellschaft                               |               |
| Auflagedatum               | 07.07.2022                  |                                   |       | Natixis Inv. M. Int.                            |               |
| KESSt-Meldefonds           | Ja                          |                                   |       | Im Trutz Frankfurt 55, 60322, Frankfurt am Main |               |
| Beginn des Geschäftsjahres | 01.07.                      |                                   |       | Deutschland                                     |               |
| Nachhaltigkeitsfondsart    | -                           |                                   |       | www.im.natixis.com                              |               |
| Fondsmanager               | Simon Aninat                |                                   |       |                                                 |               |
|                            | Victor Moussally            |                                   |       |                                                 |               |
| Thema                      | -                           |                                   |       |                                                 |               |

| Performance                    | 1M     | 6M     | YTD    | 1J     | 2J     | 3J      | 5J     | seit Beginn |
|--------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|-------------|
| Performance                    | +2,02% | +5,80% | +3,93% | +6,97% | +9,64% | +16,11% | -      | +29,77%     |
| Performance p.a.               | -      | -      | -      | +6,97% | +4,71% | +5,11%  | -      | +6,43%      |
| Performance p.a. nach max. AGA | -      | -      | -      | +5,91% | +4,19% | +4,76%  | -      | +6,17%      |
| Sharpe Ratio                   | 10,03  | 2,18   | 0,70   | 1,11   | 0,48   | 0,65    | -      | 0,81        |
| Volatilität                    | 2,38%  | 4,22%  | 4,43%  | 3,90%  | 4,32%  | 3,83%   | -      | 4,70%       |
| Schlechtester Monat            | -      | -2,03% | -2,03% | -2,03% | -2,57% | -2,57%  | -5,18% | -5,18%      |
| Bester Monat                   | -      | +2,36% | +2,36% | +2,36% | +2,36% | +2,36%  | +4,27% | +4,27%      |
| Maximaler Verlust              | -0,35% | -1,84% | -3,02% | -3,02% | -6,48% | -6,48%  | -      | -7,15%      |

Vertriebszulassung

Österreich, Deutschland, Luxemburg;

1. Wichtiger Hinweis zum Aktualisierungsstand: Das angegebene Datum bezieht sich ausschließlich auf die Berechnung des NAV.

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapiers oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapiers verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.  
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 12.09.2026 06:34

## Ostrum Total Return Volatility I/A (EUR) / LU2373384218 / A3E20V / Natixis Inv. M. Int.

### Investmentstrategie

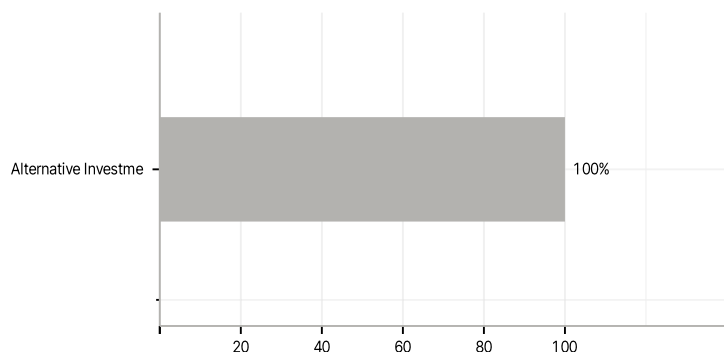
Der Teilfonds wird aktiv verwaltet. Der Teilfonds wird nicht unter Bezugnahme auf eine Benchmark verwaltet. Die Anlagepolitik des Teilfonds besteht darin, die Volatilitätsrisikoprämie der Aktienmärkte über ein Portfolio aus Optionen und Future-Kontrakten auf internationale Aktienindizes (einschließlich Schwellenländer) zu extrahieren. Die Volatilität eines Vermögenswerts - im Sinne von Standardabweichung - wird durch das Ausmaß der Schwankungen seiner Erträge in einem bestimmten Zeitraum definiert. Der Wert misst die Streuung der Erträge des Vermögenswerts um den Durchschnitt. Diese Anlagestrategie wird in erster Linie durch den Kauf und Verkauf von Optionen und Future-Kontrakten auf internationale Aktienindizes umgesetzt, die an organisierten Märkten gehandelt werden. Die Kosten der vom Anlageverwalter erworbenen Optionenpositionen können die Rendite oder Wertentwicklung des Teilfonds schmälern. Das Engagement des Teilfonds wird dynamisch entsprechend den Erwartungen des Anlageverwalters hinsichtlich der künftigen Entwicklung der Aktienmärkte und ihrer Volatilität gesteuert. Obwohl es dynamisch sein wird, wird sich der Teilfonds im Durchschnitt als Verkäufer von Volatilität und als Käufer am Aktienmarkt engagieren. Der Teilfonds strebt eine positive Wertentwicklung in steigenden Aktienmärkten bei geringer Volatilität an. Umgekehrt könnte der Teilfonds in fallenden und/oder volatilen Märkten eine deutlich negative Wertentwicklung verzeichnen. Diese Strategie wird innerhalb eines maximalen Value at Risk (VaR) (ex ante) von 20 % über 20 Tage mit einem Konfidenzintervall von...

### Investmentziel

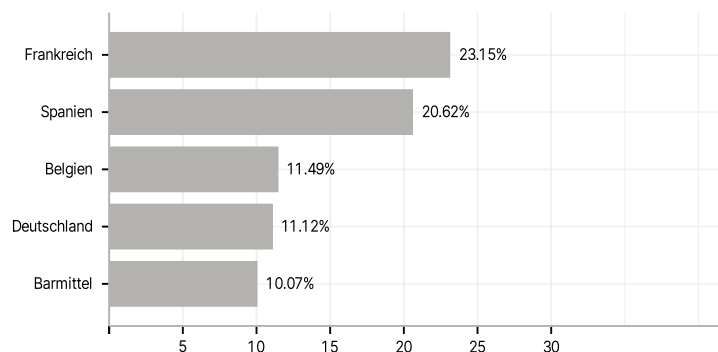
Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin zu versuchen, die mit der Volatilität der internationalen Aktienmärkte verbundene Risikoprämie über den empfohlenen Mindestanlagezeitraum von fünf (5) Jahren zu erfassen.

### Veranlagungsstruktur

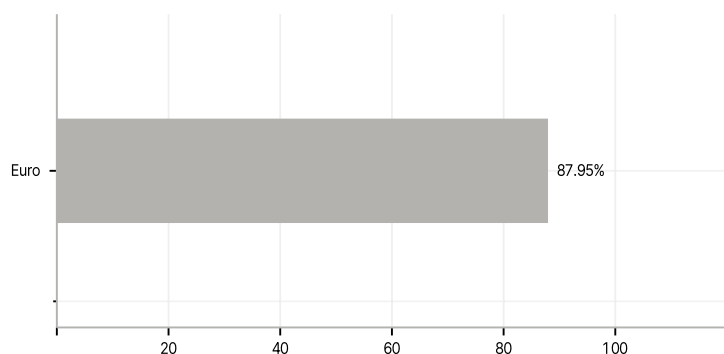
#### Anlagearten



#### Länder



#### Währungen



#### Größte Positionen

