

## Ossiam Japan Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

## DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

La stratégie Minimum Variance vise à réduire la volatilité de l'univers d'investissement tout en maintenant un niveau élevé de diversification.

La stratégie prend en compte les estimations de volatilité des actions ainsi que leur corrélation afin de construire un portefeuille « long only » défensif.

Cette approche est adaptée aux investisseurs recherchant une exposition de long terme avec une volatilité réduite par rapport à celle du marché.

- Exposition au marché actions
- Objectif de réduction de la volatilité
- Bénéficie de l'anomalie de faible volatilité

## PERFORMANCE DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

28.12.2018

— Ossiam Japan Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

— S&amp;P/TOPIX 150 Net TR Index (EUR)



Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard &amp; Poor's, calculs effectués par Ossiam

## PERFORMANCES

28/12/2018

	MTD PERF %	YTD PERF %	Perf. 1-an %	Perf. 3-ans annualisées %	Perf. 5-ans annualisées %	Annualisée depuis la création %
Fonds	-5,29	-4,72	-4,72	3,13	—	3,58
Index	-5,25	-4,09	-4,09	3,92	11,00	4,38
Univers d'investisse- ment	-8,08	-8,86	-8,86	1,68	—	2,19

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard &amp; Poor's, calculs effectués par Ossiam

## PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

28.12.2018

	Volatilité annualisée %	Alpha % annualisé	BETA	Tracking Error 1-an %	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	15,63	1,81	0,81	0,12	0,23	-15,60
Index	15,64	2,61	0,81	—	0,28	-15,51
Univers d'investis- sement	18,06	—	—	—	0,12	-20,37

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard &amp; Poor's, calculs effectués par Ossiam

**Informations importantes :** La valeur de l'investissement ainsi que son rendement peuvent varier. Votre investissement initial ne peut être garanti. Les ETFs sont échangés sur des places boursières comme des actions. Ils sont achetés et vendus à des prix de marchés qui peuvent être différents de la valeur liquidative de l'ETF.

**Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.**

**Risques spécifiques :** Veuillez noter que le fonds peut être sujet à divers risques (risque indicel, risque lié aux instruments dérivés et aux contreparties, risque de concentration géographique). Veuillez lire la section du prospectus intitulée "Risques généraux" pour de plus amples renseignements sur les risques.

Cette classe en EUR n'est pas hedgée contre le risque de change.

## PROFIL DE RISQUE ET DE RENDEMENT



Le SRRI représente le profil risque/rendement tel qu'il est présenté dans le Document d'Informations Clés pour l'Investisseur (DIC). La catégorie la moins risquée n'est pas totalement exempte de risque. Le SRRI n'est pas garanti et est susceptible de changer au fil du temps.

## CARACTÉRISTIQUES DE L'INDICE

Nom	Japan Minimum Variance Index NR (JPY)
Univers d'investissement	S&P/TOPIX 150 Net TR Index (JPY)
Ticker Bloomberg	JPMVNR Index
Date de lancement	05.10.2015
Classe d'actifs	Action
Fréquence de rebalancement	Mensuelle

## DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	State Street Bank Luxembourg S.A
Structure juridique	SICAV Luxembourgeoise
UCITS	Oui
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	JPY 2 540 932 054
Encours de la classe d'actions	EUR 20 124 634
Valeur liquidative	EUR 95,553
Nombre de parts	210 613
Devise du fonds	JPY
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU1254453738
Date de lancement	21.12.2015
Méthode de réplcation	Physique
TER (Frais/an)	0,65%

## INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire)	17h heure de Luxembourg (J-1)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
Ticker sur Euronext Paris	
Ticker Bloomberg	JPMV FP

**TOP 10 DES VALEURS (%)**  
28.12.2018

	Japan Minimum Variance Index NR	S&P/TOPIX 150 Net TR Index
TOSHIBA CORP	3,64	0,67
JAPAN TOBACCO INC	3,50	0,98
mitsubishi heavy industries	3,41	0,45
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	3,40	1,44
NEC CORP	3,29	0,28
NITORI HOLDINGS CO LTD	3,23	0,40
KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC	3,11	0,21
SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	2,80	1,27
SHIMANO INC	2,79	0,44
JAPAN AIRLINES CO LTD	2,76	0,45

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam



**ALLOCATION  
SECTORIELLE  
(28.12.2018)**

■ Japan Minimum Variance Index NR (JPY)  
■ S&P/TOPIX 150 Net TR Index (JPY)

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

MT : Materials • CS : Consumer Staples • CD : Consumer Discretionary • FN : Financials • HC : Health Care • ID : Industrials • EN : Energy • RE : Real Estate • CM : Communications Services • IT : Information Technology • UL : Utilities

**CONTACT / INFO**

www.ossiam.com  
mail : info@ossiam.com  
TEL +33 1 84 79 42 70  
80 av. de la Grande Armée  
75017 PARIS - FRANCE

Le présent document est un document à caractère commercial et non un document à caractère réglementaire.

Ossiam Lux (la « SICAV ») est une Société d'Investissement à Capital Variable luxembourgeoise composée de plusieurs compartiments distincts (constituant chacun un « Fonds »). La SICAV a reçu le visa de la Commission de Surveillance du Secteur Financier du grand-duché de Luxembourg. La SICAV a nommé Ossiam sa société de gestion, responsable de la gestion financière des fonds, l'administration et la distribution de la SICAV. La société de gestion a nommé State Street Luxembourg en qualité d'Agent administrateur, Agent payeur, Agent de domiciliation et Corporate agent, et Agent de registre et de transfert de la SICAV. Ossiam, filiale de Natixis Investment Managers (anciennement Natixis Global Asset Management), est agréée par l'Autorité des Marchés Financiers en qualité de Société de Gestion de Portefeuille sous le numéro GP-10000016. Le fonds OSSIAM JAPAN MINIMUM VARIANCE NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 07/01/2016.

OSSIAM a conclu un contrat avec S&P Opco LLC, une filiale de S&P Dow Jones Indices, pour le calcul et la mise à jour des indices JAPAN MINIMUM VARIANCE NR et JAPAN MINIMUM VARIANCE EURO HEDGED NR (« les Indices »). Les Indices ne sont aucunement financés par S&P Dow Jones Indices LLC ou ses filiales ou fournisseurs de licences tiers, dont Standard & Poor's Financial Services LLC et Dow Jones Trademark Holdings LLC (ensemble « S&P Dow Jones Indices »). S&P Dow Jones Indices se dégage de toute responsabilité pour toute erreur ou omission dans le calcul des Indices. « Calculated by S&P Dow Jones Indices » et sa ou ses marque(s) stylisée(s) connexe(s) sont des marques de service de S&P Dow Jones Indices pour lesquelles Ossiam a obtenu une licence d'utilisation. S&P® est une marque déposée de Standard & Poor's Financial Services LLC, et Dow Jones® est une marque déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC. S&P DOW JONES INDICES NE GARANTIT EN AUCUN CAS LA PERTINENCE, L'EXACTITUDE, LA VALIDITÉ ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE Y AFFÉRENTE, OU DE TOUTE COMMUNICATION Y AFFÉRENTE, DONT ENTRE AUTRES, LES COMMUNICATIONS VERBALES, ÉCRITES ET ÉLECTRONIQUES. S&P DOW JONES INDICES NE PEUT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE DES DOMMAGES OU PERTES SURVENUS SUITE À DES ERREURS, OMISSIONS OU RETARDS LIÉS AUX INDICES, AUX DONNÉES ET AUX COMMUNICATIONS SUSMENTIONNÉS. S&P DOW JONES INDICES NE FORMULE AUCUNE GARANTIE, QU'ELLE SOIT EXPRESSE OU IMPLICITE, ET DÉNIE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE QUANT À LA QUALITÉ MARCHANDE OU À LA PERTINENCE POUR UN BUT OU UN USAGE PRÉCIS, OU QUANT AUX RÉSULTATS À OBTENIR PAR OSSIAM, PAR LES ACTIONNAIRES DU FONDS OU PAR TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ DE PAR L'UTILISATION DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE Y AFFÉRENTE. SANS LIMITATION DE CE QUI PRÉCÈDE, S&P DOW JONES INDICES NE PEUT EN AUCUN CAS ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE D'UN QUELCONQUE DOMMAGE INDIRECT, SPÉCIAL, MINEUR, PUNITIF OU IMPORTANT, DONT, SANS S'Y LIMITER, LES MANQUES À GAGNER, PERTES D'EXPLOITATION, PERTES DE TEMPS OU DÉGRADATIONS D'ACTIFS INCORPORELS, MÊME DANS LES CAS OÙ ILS ONT ÉTÉ INFORMÉS DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES, QUE CE SOIT EN VERTU D'UNE RESPONSABILITÉ CONTRACTUELLE, DÉLICTEUSE, CIVILE OU AUTRE.

L'accès aux produits et services décrits dans ce document peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays. Aucun des produits ou services présentés ici ne sera fourni par Ossiam à une personne si la loi de son pays d'origine, ou de tout autre pays qui la concernerait, l'interdit. Les mêmes règles s'appliquent dans les pays pour lesquels Ossiam n'a pas reçu d'autorisation de commercialisation.