

Ossiam Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

La stratégie Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit suit la performance d'une sélection de 100 obligations, parmi les composants de l'indice Solactive Euro IG Corporate, en s'appuyant sur des mesures quantitatives calculées par Moody's Analytics.

La stratégie sélectionne un portefeuille équilibré de 100 obligations qui, selon les mesures quantitatives établies par Moody's Analytics, figurent parmi la partie la plus liquide de l'univers d'investissement, apparaissent sous évaluées, et ont une probabilité de défaut faible, en se basant sur la mesure EDFTM de Moody's Analytics.

Cette sélection est neutre en durée et en allocation sectorielle (exposition aux secteurs financiers et non financiers) par rapport à son univers d'investissement. La stratégie attribue un poids maximal de 5% par émetteur. Cette sélection est revue trimestriellement.

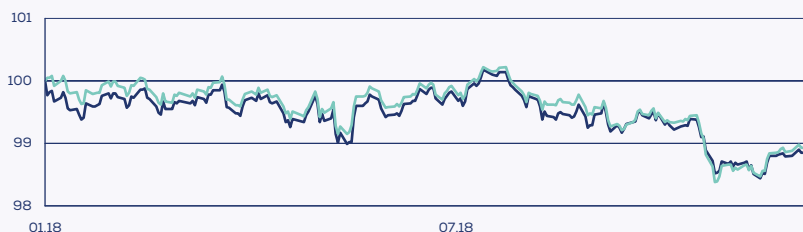
La stratégie vise à :

- réduire les inefficiences présentes sur les indexations classiques du marché obligataires
- maintenir un risque de crédit réduit
- maximiser le rendement d'une sélection liquide et diversifiée d'obligations d'entreprises Investment Grade libellées en Euro

PERFORMANCE DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

31.12.2018

— Ossiam Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit UCITS ETF 1C (EUR)
— Solactive Euro IG Corporate Index (EUR)



Ossiam/Moody's Analytics/Solactive, calculs effectués par Ossiam

PERFORMANCES

31/12/2018

	MTD PERF %	YTD PERF %	Perf. 1-an %	Perf. 3-ans annualisées %	Perf. 5-ans annualisées %	Annualisée depuis la création %
Fonds	0,34	-1,40	-1,40	—	—	-1,39
Indice	0,39	-0,91	-0,91	1,91	2,84	-0,90
Univers d'investissement	0,20	-1,22	-1,22	1,91	2,60	-1,22

Ossiam/Moody's Analytics/Solactive, calculs effectués par Ossiam

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

31.12.2018

	Volatilité annualisée %	Alpha % annualisé	BETA	Tracking Error 1-an %	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	1,56	-0,30	0,90	0,02	-0,89	-2,19
Index	1,56	0,20	0,90	—	-0,58	-1,78
Univers d'investissement	1,66	—	—	—	-0,74	-1,94

Ossiam/Moody's Analytics/Solactive, 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.

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 (DICI). 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	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index (EUR)
Univers d'investissement	Solactive Euro IG Corporate Index (EUR)
Ticker Bloomberg	SOLMASCR Index
Date de lancement	22.11.2017
Classe d'actifs	Fixed Income
Fréquence de rebalancement	Mensuel

DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	State Street Bank Luxembourg S.A
Structure juridique	SICAV Luxembourgeoise
UCITS	Oui
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	EUR 40 468 924
Encours de la classe d'actions	EUR 40 468 924
Valeur liquidative	EUR 176,376
Nombre de parts	229 447
Devise du fonds	EUR
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU1093307442
Date de lancement	29.12.2017
Méthode de réplification	Synthétique
TER (Frais/an)	0,35%

INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire)	15h45 heure du Luxembourg
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
Ticker sur Euronext Paris	
Ticker Bloomberg	MOOC FP

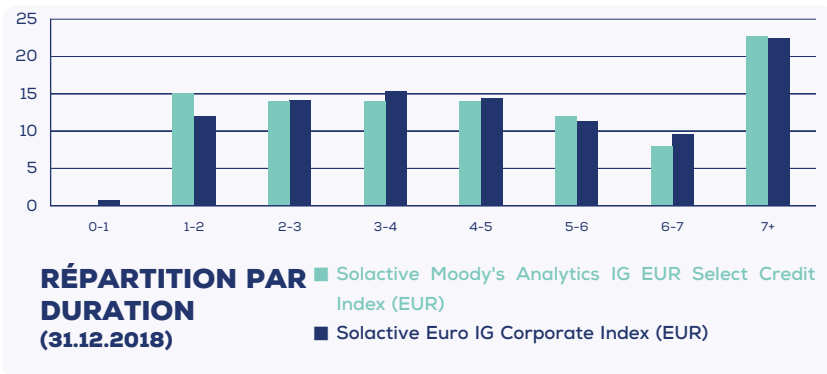
TOP 10 DES VALEURS (%)
31.12.2018

	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index	Solactive Euro IG Corporate Index
HON 2 1/4 02/22/28	1,02	0,04
BOND ASSICURAZIONI GENERALI 2026-05-04 4.125	1,02	0,05
AAPL 1 3/8 01/17/24	1,01	0,05
BRK 1 5/8 03/16/35	1,01	0,05
INTNED 1 1/8 02/14/25	1,01	0,05
PG 4 7/8 05/11/27	1,01	0,07
ACAFP 3.15 12/23/23	1,01	0,04
BRK 2.15 03/15/28	1,01	0,04
BRK 1 1/8 03/16/27	1,01	0,06
BOND PROCTER & GAMBLE CO/THE 2022-08-16 2.0	1,01	0,05

CARACTÉRISTIQUES DU PORTEFEUILLE
(31.12.2018)

	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index	Solactive Euro IG Corporate Index
Duration (en année)	4,79	5,01
Duration Ajustée (en année)	4,71	4,94
EDF (Expected Default Frequency) %	0,15	0,20
Yield to Maturity %	1,25	1,27

Ossiam/Moody's Analytics/Solactive, calculs effectués par Ossiam



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 du 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.

« L'instrument financier n'est ni sponsorisé, promu, vendu ou soutenu de quelque manière que ce soit par Solactive AG qui n'apporte aucune garantie, explicite ou implicite, concernant les résultats obtenus en utilisant l'Indice et/ou la marque de commerce de l'Indice ou le Cours de l'Indice à quelque moment que ce soit ou à tout autre égard. L'Indice est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait tout son possible pour assurer que l'Indice est calculé correctement. Quelles que soient ses obligations envers l'Émetteur, Solactive AG n'est pas tenu d'informer les tierces parties, dont les investisseurs et/ou les intermédiaires financiers de l'instrument, des erreurs identifiées dans l'Indice. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG ni la concession sous licence de la marque de l'Indice dans le but de l'utiliser avec l'instrument financier ne saurait constituer une recommandation de Solactive AG d'investir du capital dans ledit instrument financier ni ne représente une garantie ou une opinion de Solactive AG concernant quelque placement que ce soit dans cet instrument financier. »

« Le Fonds n'est ni sponsorisé, promu, vendu ou soutenu de quelque manière que ce soit par Moody's Analytics qui n'apporte aucune garantie, explicite ou implicite, concernant les résultats obtenus en utilisant l'Indice et/ou la marque de commerce ou les données Moody's Analytics à quelque moment que ce soit ou à tout autre égard. Certaines données financières quantitatives utilisées par Solactive AG pour le calcul et la publication de l'Indice sont fournies par Moody's Analytics. Quelles que soient ses obligations envers l'Émetteur et Solactive AG, Moody's Analytics n'est pas tenu d'informer les tierces parties, dont les investisseurs et/ou les intermédiaires financiers du Fonds, des erreurs identifiées dans les données. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG ni la concession sous licence de données ou de la marque Moody's Analytics dans le but de l'utiliser avec l'Indice et le Fonds ne saurait constituer une recommandation de Moody's Analytics d'investir du capital dans ledit Fonds ni ne représente une garantie ou une opinion de Moody's Analytics concernant quelque placement que ce soit dans ce Fonds. »