

## Ossiam iSTOXX® Europe 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

31.12.2018

— Ossiam iSTOXX® Europe Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)  
— STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)



Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, 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	-5,57	-5,04	-5,04	0,69	5,29	7,28
Index	-5,54	-4,86	-4,86	0,95	5,62	7,66
Univers d'investisse- ment	-5,46	-10,77	-10,77	-0,04	3,42	5,91

Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, 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	11,62	3,38	0,66	0,10	0,63	-18,39
Index	11,63	3,75	0,66	—	0,66	-18,06
Univers d'investis- sement	16,13	—	—	—	0,37	-25,21

Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, 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 (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	iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR (EUR)
Univers d'investissement	STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)
Ticker Bloomberg	ISEMVT Index
Date de lancement	14.06.2011
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	Oui
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	EUR 318 459 131
Encours de la classe d'actions	EUR 210 317 246
Valeur liquidative	EUR 164,059
Nombre de parts	1 281 958
Devise du fonds	EUR
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU0599612842
Date de lancement	21.06.2011
Méthode de réplcation	Synthétique
TER (Frais/an)	0,65%

### INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire)	16h heure du Luxembourg
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
Ticker sur Euronext Paris	
Ticker Bloomberg	EURMV FP

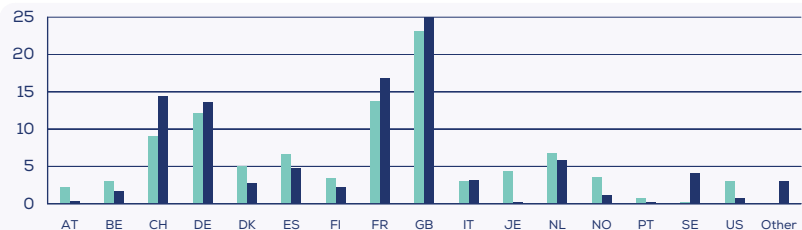
**TOP 10 DES VALEURS (%)**  
31.12.2018

	iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR	STOXX® Europe 600 Index NR
RANDGOLD RESOURCES LTD	4,36	0,09
PEARSON PLC	3,38	0,11
UNILEVER NV	3,07	0,98
AROUNDTOWN SA	2,95	0,07
AKZO NOBEL NV	2,89	0,24
UCB SA	2,75	0,12
SHIRE PLC	2,68	0,64
UNILEVER PLC	2,63	0,74
ASSICURAZIONI GENERALI	2,53	0,27
TESCO PLC	2,47	0,28

Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, calculs effectués par Ossiam

**CONTACT / INFO**

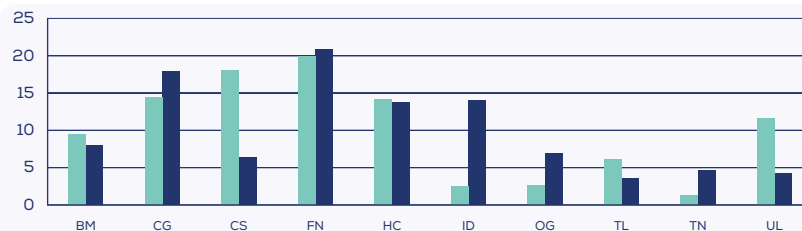
www.ossiam.com  
mail : info@ossiam.com  
TEL +33 1 84 79 42 70  
80 av. de la Grande Armée  
75017 PARIS - FRANCE



**ALLOCATION GÉOGRAPHIQUE**  
(31.12.2018)

■ iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR (EUR)  
■ STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)  
Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, calculs effectués par Ossiam.

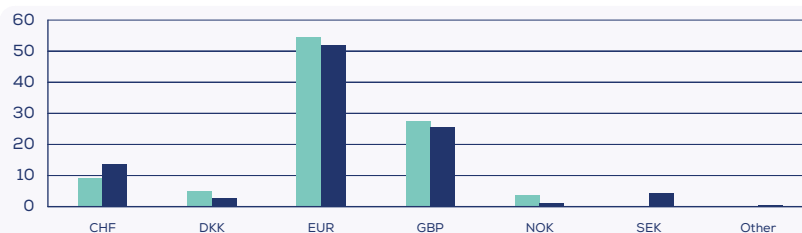
AT : Austria • BE : Belgium • CH : Switzerland • DE : Germany • DK : Denmark • ES : Spain • FI : Finland • FR : France • GB : United Kingdom • IT : Italy • JE : Jersey • NL : Netherlands • NO : Norway • PT : Portugal • SE : Sweden • US : United States



**ALLOCATION SECTORIELLE**  
(31.12.2018)

■ iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR (EUR)  
■ STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)  
Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, calculs effectués par Ossiam

BM : Basic Materials • CG : Consumer Goods • CS : Consumer Services • FN : Financials • HC : Health Care • ID : Industrials • OG : Oil - Gas • TL : Telecommunications • TN : Technology • UL : Utilities



**ALLOCATION PAR DEVICES**  
(31.12.2018)

■ iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR (EUR)  
■ STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)  
Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, calculs effectués par Ossiam

CHF : Swiss Franc • DKK : Danish krone • EUR : Euro • GBP : British Pound • NOK : Krona Norwegia • SEK : Swedish Krona

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. Le fonds OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 17/06/2011.

STOXX et ses concédants déclinent toute responsabilité relative au OSSIAM iSTOXX® Europe Minimum Variance NR. Plus précisément, STOXX et ses concédants ne fournissent ni n'assurent aucune garantie, expresse ou implicite, que ce soit concernant : Les résultats devant être obtenus par OSSIAM iSTOXX® Europe Minimum Variance NR, le détenteur de parts de OSSIAM iSTOXX® Europe Minimum Variance NR ou toute personne impliquée dans l'utilisation de l'indice iSTOXX® Europe Minimum Variance Index et des données incluses dans cet indice ; L'exactitude ou l'exhaustivité de l'indice iSTOXX® Europe Minimum Variance Index et des données qu'il contient ; La négociabilité de l'indice iSTOXX® Europe Minimum Variance Index et de ses données ainsi que leur adéquation à un usage précis ou à une fin particulière ; STOXX et ses concédants ne peuvent être tenus pour responsables de quelque erreur, omission ou interruption que ce soit dans l'indice iSTOXX® Europe Minimum Variance Index ou les données qu'il contient ; STOXX ou ses Concédants ne peuvent en aucun cas être tenus pour responsables de tout manque à gagner ou de dommages ou pertes indirects, punitifs ou particuliers, même si STOXX et ses concédants savent que ces risques existent. Le contrat de licence entre (détenteur de licence) et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs de parts de OSSIAM iSTOXX® Europe Minimum Variance NR ou de tiers.

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.