

## Ossiam Emerging Markets 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 Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)  
— SP/IFCI® Composite NR (EUR)



Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, 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	-1,71	-2,36	-2,36	6,04	4,24	4,42
Indice	-1,57	-0,73	-0,73	7,78	5,99	6,18
Univers d'investisse- ment	-3,50	-10,24	-10,24	7,21	6,14	4,06

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, 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	12,52	1,35	0,76	0,07	0,35	-27,92
Index	12,53	3,11	0,76	—	0,49	-27,05
Univers d'investis- sement	15,01	—	—	—	0,27	-33,50

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & 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 (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	Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)
Univers d'investissement	SP/IFCI® Composite NR (USD)
Ticker Bloomberg	OEMMVNR Index
Date de lancement	24.01.2012
Classe d'actifs	Action
Fréquence de rebalancement	Semestrielle

### DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	State Street Bank Luxembourg S.A
Structure juridique	SICAV Luxembourgeoise
UCITS	Oui
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	USD 133 622 484
Encours de la classe d'actions	EUR 110 987 633
Valeur liquidative	EUR 107,567
Nombre de parts	1 031 799
Devise du fonds	USD
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU0705291903
Date de lancement	03.02.2012
Méthode de réplcation	Synthétique
TER (Frais/an)	0,75%

### INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

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

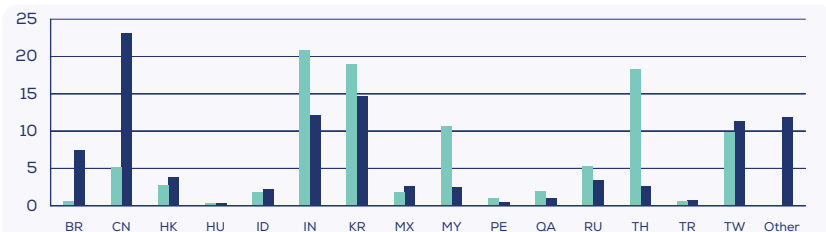
## › Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

### TOP 10 DES VALEURS (%)

31.12.2018

	Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR	SP/IFCI® Composite NR
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,85	0,09
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,81	0,24
TENAGA NASIONAL BHD	2,75	0,15
PUBLIC BANK BHD	2,62	0,26
SIAM CEMENT PCL/THE	2,01	0,07
BANGKOK DUSIT MED SERVICE	2,00	0,05
QATAR NATIONAL BANK	1,95	0,41
CHINA MOBILE LTD	1,91	0,92
MALAYAN BANKING BHD	1,81	0,21
SK TELECOM CO LTD	1,81	0,17

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

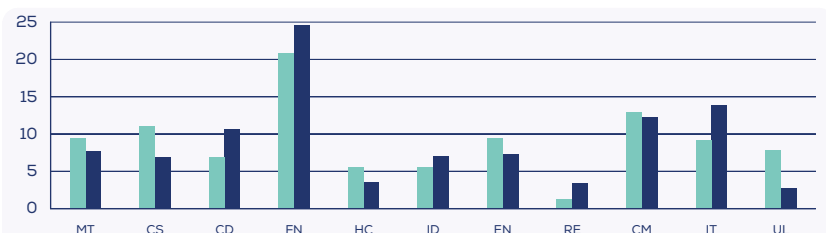


### ALLOCATION GÉOGRAPHIQUE (31.12.2018)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)  
■ SP/IFCI® Composite NR (USD)

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

BR: Brazil • CN: China • HK: Hong Kong • HU: Hungary • ID: Indonesia • IN: India • KR: Korea • MX: Mexico • MY: Malaysia • PE: Peru • QA: Qatar • RU: Russian Federation • TH: Thailand • TR: Turkey • TW: Taiwan

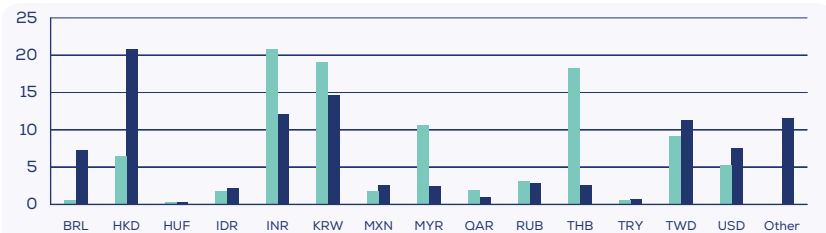


### ALLOCATION SECTORIELLE (31.12.2018)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)  
■ SP/IFCI® Composite NR (USD)

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



### ALLOCATION PAR DEVICES (31.12.2018)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)  
■ SP/IFCI® Composite NR (USD)

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

BRL: Brazil Real • HKD: Hong Kong Dollar • HUF: Hungarian Forint • IDR: Indonesian Rupiah • INR: Indian Rupiah • KRW: South Korean Won • MXN: Mexican Peso • MYR: Malaysian Ringgit • QAR: Qatar Riyal • RUB: Russian Ruble • THB: Thai Baht • TRY: Turkish Lira • TWD: Taiwan New Dollar • USD: US Dollar

### 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 Natix Investment Managers (anciennement Natix 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 EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 01/03/2012.

OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR n'est en aucun cas financé, approuvé, vendu ou promu par Standard & Poor's Financial Services LLC (« S&P »), par ses filiales ou par ses concédants. S&P, ses filiales et ses concédants ne font aucune déclaration et n'émettent aucune garantie, qu'elle soit expresse ou implicite, vis-à-vis des détenteurs de parts de OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR ou de toute autre personne quant au bien-fondé d'un investissement en général en valeurs mobilières ou en particulier dans OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR ou quant à la capacité de l'indice Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index Net Return USD (l'« Indice ») à suivre les performances générales du marché des actions. S&P et ses concédants tiers n'entretiennent avec Ossiam qu'une relation d'octroi de licences pour certaines marques, marques de services et marques déposées par S&P et/ou ses concédants tiers et de prise en charge des calculs et des services de maintenance liés à l'Indice. S&P, ses filiales et ses concédants tiers ne peuvent être tenus pour responsables de, ni n'ont participé à la détermination des prix et du montant de OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR, à la planification de l'émission ou de la vente de OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR ou à la détermination ou au calcul de l'équation par laquelle OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR est converti en liquidités. S&P n'a aucune obligation ni responsabilité quant à la gestion, à la mise sur le marché ou au négoce de OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR.

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.