

Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF 1C (USD)

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 utilise les estimations de volatilité des actions ainsi que leur corrélation afin de construire un portefeuille « long only » défensif.

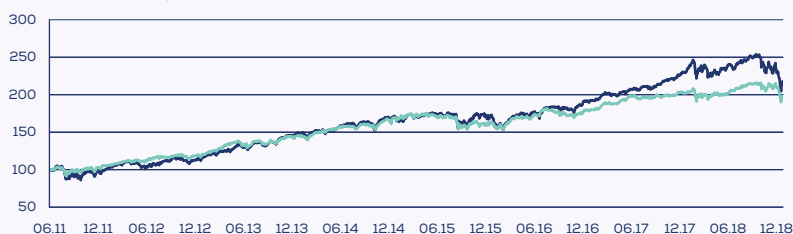
Le processus d'optimisation est appliqué à un univers d'actions filtré selon des critères ESG (70% des actions les mieux notées en accord avec les critères ESG sont conservés pour chaque sous-secteur ; les actions sujettes à controverse sont exclues ; la sélection repose sur une échelle d'évaluation mise en place par Sustainalytics).

Cette approche est adaptée aux investisseurs recherchant une exposition de long terme avec une volatilité moins importante que celle du marché et tenant compte des critères ESG.

- Exposition au marché actions avec une approche ESG
- Objectif de réduction de la volatilité
- Bénéficie de l'anomalie de faible volatilité

PERFORMANCE DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT
31.12.2018

— Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF 1C (USD)
— Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)



Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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	-7,24	-1,91	-1,91	6,96	6,30	9,46
Indice	-7,20	-1,53	-1,53	7,28	6,51	9,69
Univers d'investissement	-8,98	-4,80	-4,80	8,59	7,83	10,85

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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	10,94	2,06	0,68	0,40	0,86	-12,69
Index	10,94	2,29	0,68	—	0,88	-12,78
Univers d'investissement	14,75	—	—	—	0,74	-19,46

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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 indiciel, 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.

*L'indice de référence (ainsi que son Benchmark) est calculé en utilisant la performance de l'Indice Ossiam US Minimum Variance NR (resp. S & P 500 Index NR) jusqu'au 16 juin 2017 et la performance de l'US ESG Minimum Variance NR Index (resp. NR Solactive US Large CAP Index) par la suite. Cela reflète le changement de référence qui est entré en vigueur sur le fonds le 16 juin 2017.

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	US ESG Minimum Variance Index NR* (USD)
Univers d'investissement	Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)
Ticker Bloomberg	ESGUSMVN Index
Date de lancement	06.06.2011
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	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	USD 304 527 926
Encours de la classe d'actions	USD 195 697 372
Valeur liquidative	USD 191,877
Nombre de parts	1 019 911
Devise du fonds	USD
Devise de la classe d'actions	USD
ISIN	LU0599612412
Date de lancement	07.06.2011
Méthode de réplification	Physique
TER (Frais/an)	0,65%

INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

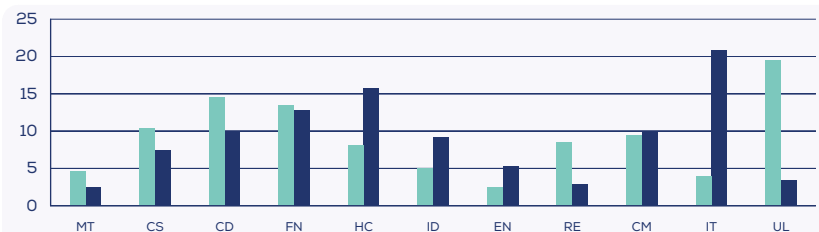
Heure limite de réception des ordres (marché primaire)	16h15 heure du Luxembourg
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
Ticker sur Euronext Paris	
Ticker Bloomberg	MVUS FP

TOP 10 DES VALEURS (%)

31.12.2018

	US ESG Minimum Variance Index NR *	Solactive US Large Cap Net TR Index*	Notation ESG
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	4,60	0,24	50,45
NEWMONT MINING CORP	4,47	0,09	78,08
CME GROUP INC	3,73	0,30	53,17
REPUBLIC SERVICES INC	3,24	0,07	54,88
SEMPRA ENERGY	2,98	0,13	68,75
MCDONALD'S CORP	2,61	0,65	56,05
COCA-COLA CO/THE	2,56	0,86	64,06
MERCK & CO. INC.	2,54	0,97	67,23
CITRIX SYSTEMS INC	2,52	0,06	57,12
NEXTERA ENERGY INC	2,49	0,39	67,02

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

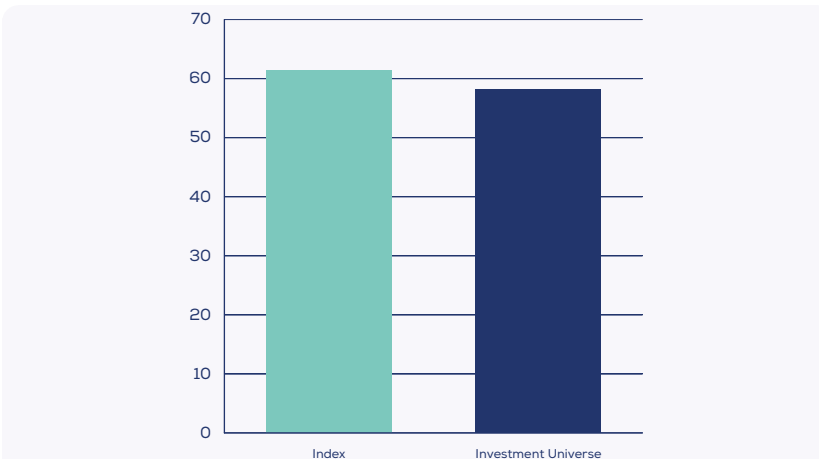


ALLOCATION SECTORIELLE (31.12.2018)

■ US ESG Minimum Variance Index NR* (USD)
■ Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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



NOTATION ESG MOYENNE (31.12.2018)

■ US ESG Minimum Variance Index NR* (USD)
■ Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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. Le fonds OSSIAM US MINIMUM VARIANCE ESG NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 17/06/2011.

L'instrument financier OSSIAM US ESG MINIMUM VARIANCE NR n'est ni parrainé, ni approuvé, ni vendu ou préconisé par Solactive AG. Solactive AG n'offre aucune garantie ou assurance que ce soit concernant l'Indice lui-même ou l'utilisation de l'Indice à tout moment. L'Indice de stratégie est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait de son mieux pour que l'indice soit correctement calculé. Indépendamment de ses obligations envers l'Emetteur, Solactive AG n'a aucune obligation de signaler les erreurs de l'indice à des tiers, y compris mais sans s'y limiter à des investisseurs et / ou des intermédiaires financiers de l'instrument financier. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG ni la licence de l'Indice ou la marque de l'Indice à des fins d'utilisation dans le cadre de l'instrument financier ne constitue une recommandation de Solactive AG d'investir des capitaux dans ledit instrument financier et ne représente en aucune manière une assurance ou l'opinion de Solactive AG à l'égard de tout investissement dans cet instrument financier. Rappelez-vous, les informations contenues dans ce document ne constituent pas une recommandation d'achat ou de vente de titres. Les informations et opinions contenues dans ce document ont été obtenues auprès de sources publiques considérées comme fiables, mais aucune représentation ou garantie, expresse ou implicite, n'est faite sur exactitude des informations présentes.

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.