

Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

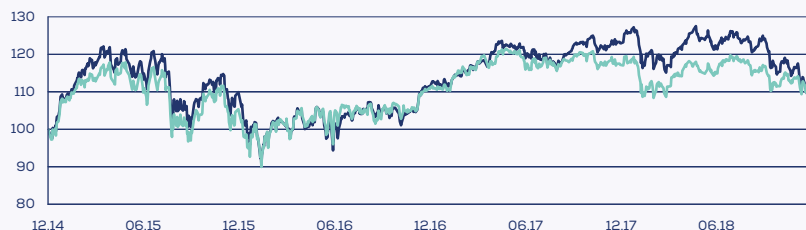
La stratégie Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value est une stratégie systématique de type « value » fondée sur les travaux du Professeur Robert Shiller. Elle offre une exposition aux actions européennes grâce à une sélection des secteurs faite à partir du Cyclically Adjusted Price-to-Earnings (CAPE®) ratio qui permet de sélectionner les secteurs potentiellement sous-évalués. Cette stratégie qui vise à offrir une exposition aux grandes capitalisations avec un biais « value », s'adresse à des investisseurs de long terme.

- Exposition aux actions européennes à travers une sélection de secteurs basée sur le ratio CAPE®
- Un outil de valorisation fondé sur les travaux du professeur Shiller
- Un processus d'investissement visant à identifier les secteurs potentiellement sous-évalués sur le long terme

PERFORMANCE DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

28.12.2018

— Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)
— MSCI Europe Net Return Index (EUR)



Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, 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	-4,47	-7,44	-7,44	1,20	-	2,05
Indice	-4,43	-6,94	-6,94	1,84	3,19	2,74
Univers d'investis- ment	-5,92	-10,94	-10,94	0,06	-	2,29

Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, 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	16,84	-0,15	0,96	0,04	0,12	-23,68
Index	16,84	0,54	0,96	-	0,16	-23,27
Univers d'investis- sment	16,78	-	-	-	0,14	-25,92

Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, 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.

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	Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (EUR)
Univers d'investissement	MSCI Europe Net Return Index (EUR)
Ticker Bloomberg	BXIICESE Index
Date de lancement	29.08.2013
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 61 815 885
Encours de la classe d'actions	EUR 61 815 885
Valeur liquidative	EUR 288,136
Nombre de parts	214 537
Devise du fonds	EUR
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU1079842321
Date de lancement	30.12.2014
Méthode de réplcation	Synthétique
TER (Frais/an)	0,65%

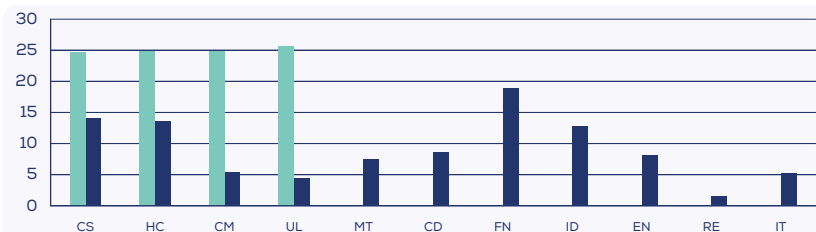
INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire)	14h45 pm heure de Luxembourg
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
Ticker sur Euronext Paris	
Ticker Bloomberg	CAPE FP

TOP 10 DES VALEURS (%)
28.12.2018

	Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index	MSCI Europe Net Return Index
NESTLE SA	5,58	3,18
NOVARTIS AG	4,50	2,37
ROCHE HOLDING AG	4,22	2,22
IBERDROLA SA	3,79	0,63
ENEL SPA	3,70	0,60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,40	0,72
VODAFONE GROUP PLC	3,16	0,67
NATIONAL GRID PLC	2,61	0,42
TELEFONICA SA	2,38	0,50
SANOFI	2,35	1,25

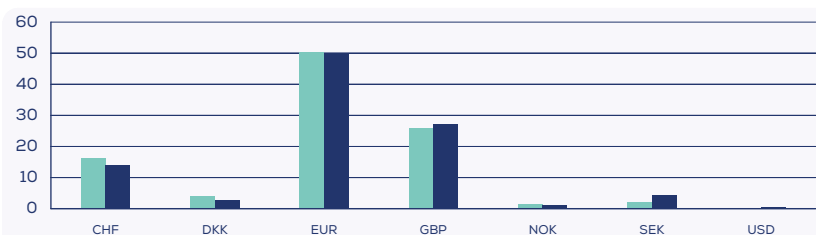
Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, calculs effectués par Ossiam



ALLOCATION SECTORIELLE
(28.12.2018)

■ Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (EUR)
■ MSCI Europe Net Return Index (EUR)
Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, 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 DEVISES
(28.12.2018)

■ Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (EUR)
■ MSCI Europe Net Return Index (EUR)
Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, calculs effectués par Ossiam

CHF : Swiss Franc • DKK : Danish krone • EUR : Euro • GBP : British Pound • NOK : Krona Norvegia • SEK : Swedish Krona • 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 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 SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 19/01/2015.

Le fonds OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) n'est en aucune façon sponsorisé, avalisé, vendu ou promu par BARCLAYS. BARCLAYS n'aura aucune responsabilité pour les éventuelles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR. «Barclays Bank PLC et ses affiliés ("Barclays") n'est pas l'émetteur ou le producteur de l'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR et Barclays n'a aucune responsabilité ou obligation ni aucun devoir à l'égard des personnes qui investissent dans l'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) sauf en ce qui concerne la distribution de ces produits en vertu d'une convention avec OSSIAM. L'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR est une marque dont Barclays Bank PLC ou Barclays Capital Inc. a la propriété et qui fait l'objet d'une licence par OSSIAM en qualité d'émetteur de l'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR). OSSIAM peut pour son propre compte conclure des transactions avec Barclays relatives à l'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR et en lien avec l'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) ; cependant, les investisseurs acquièrent des ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) n'acquièrent pas de droits dans l'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR et n'ont aucune relation quelconque avec Barclays lorsqu'ils investissent dans l'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR). L'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) n'est pas sponsorisé ou vendu par Barclays et ne fait pas l'objet de démarchage par Barclays et Barclays n'émet aucune déclaration ou garantie sur le caractère adéquat de l'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) ou l'usage de l'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR ou de toute donnée incluse dans ces indices, sauf en ce qui concerne leur commercialisation en vertu d'une convention conclue avec OSSIAM. Barclays ne pourra en aucun cas être tenu responsable à l'égard de l'émetteur, des investisseurs ou de tiers en ce qui concerne l'usage ou l'exactitude de l'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR ou de toute donnée incluse dans cet indice.

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.