

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

DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

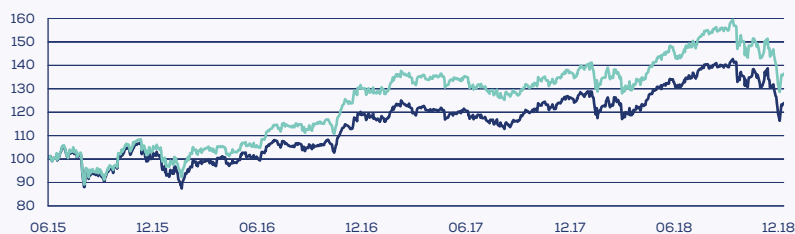
La stratégie Shiller Barclays CAPE® US Sector Value est une stratégie systématique de type « value » fondée sur les travaux du Professeur Robert Shiller. Elle offre une exposition aux actions américaines grâce à une sélection des secteurs faite à partir du Cyclically Adjusted Price-to-Earnings (CAPE®) 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 américaines 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

31.12.2018

Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)
S&P 500® Index NR (EUR)



Ossiam/Bloomberg/Barclays/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	-9,56	1,39	1,39	9,16	-	9,20
Indice	-9,50	2,12	2,12	9,73	15,01	9,74
Univers d'investissement	-9,94	-0,15	-0,15	6,75	11,92	6,26

Ossiam/Bloomberg/Barclays/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	16,98	3,03	0,99	0,07	0,54	-19,33
Index	16,99	3,57	0,99	-	0,57	-19,21
Univers d'investissement	16,98	-	-	-	0,37	-18,49

Ossiam/Bloomberg/Barclays/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 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.

Cette classe en EUR n'est pas hedgée contre le risque de change.

PROFIL DE RISQUE ET DE RENDEMENT

RISQUE PLUS FAIBLE RISQUE PLUS ÉLEVÉ



RENDEMENTS GÉNÉRALEMENT PLUS FAIBLES

RENDEMENTS GÉNÉRALEMENT PLUS ÉLEVÉS

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® US Sector Value Net TR Index (USD)

Univers d'investissement S&P 500® Index NR (USD)

Ticker Bloomberg BXIICUSU Index

Date de lancement 05.10.2012

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 1 414 368 150

Encours de la classe d'actions EUR 357 195 856

Valeur liquidative EUR 524,994

Nombre de parts 680 381

Devise du fonds USD

Devise de la classe d'actions EUR

ISIN LU1079841273

Date de lancement 22.06.2015

Méthode de réplification Synthétique

TER (Frais/an) 0,65%

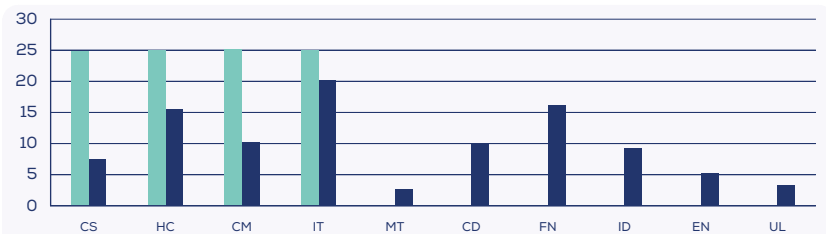
INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire) 16h heure de Luxembourg

Investissement minimum (marché secondaire) 1 Action

Ticker sur Euronext Paris

Ticker Bloomberg CAPU FP



**ALLOCATION
SECTORIELLE
(31.12.2018)**

■ Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index (USD)

■ S&P 500® Index NR (USD)

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

MT : Materials • CS : Consumer Staples • CD : Consumer Discretionary • FN : Financial and Real Estate • HC : Health Care • ID : Industrials • EN : Energy • CM : Communications Services • IT : Information Technology • UL : Utilities

TOP 10 DES VALEURS (%)

31.12.2018

	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index	S&P 500® Index NR
MICROSOFT CORP	4,63	3,72
APPLE INC	4,20	3,38
FACEBOOK INC-A	4,08	1,53
PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,63	1,09
ALPHABET INC-CL C	3,06	1,53
ALPHABET INC-CL A	3,00	1,50
COCA-COLA CO/THE	2,88	0,87
JOHNSON & JOHNSON	2,65	1,64
PEPSICO INC	2,47	0,75
WALMART INC	2,10	0,63

Ossiam/Bloomberg/Barclays/Standard & Poor's, 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 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 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® US SECTOR VALUE TR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 01/07/2015.

Le fonds OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR 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® US 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® US 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® US SECTOR VALUE TR sauf en ce qui concerne la distribution de ces produits en vertu d'une convention avec OSSIAM. L'indice Shiller Barclays CAPE® US 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® US SECTOR VALUE TR. OSSIAM peut pour son propre compte conclure des transactions avec Barclays relatives à l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR et en lien avec l'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (USD) ; cependant, les investisseurs acquièrent des ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR n'acquièrent pas de droits dans l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR et n'ont aucune relation quelconque avec Barclays lorsqu'ils investissent dans l'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR. L'ETF OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR 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® US SECTOR VALUE TR ou l'usage de l'indice Shiller Barclays CAPE® US 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® US 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.