

Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity Ex Grains TR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

La stratégie Risk Weighted Enhanced Commodity est une approche systématique « long-only » qui vise à offrir une exposition aux matières premières avec une volatilité réduite par rapport à l'univers d'investissement. Contrairement aux indices standards fortement concentrés et exposés au risque de contango, la stratégie Risk Weighted Enhanced Commodity combine une allocation des risques efficiente ainsi que des techniques d'optimisation des « rolls » des contrats futures afin d'en limiter les effets négatifs.

- Exposition à l'ensemble des matières première (excluant les céréales)
- Réduction du risque
- Diversification et optimisation du roll

PERFORMANCE DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

29.03.2019

— Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity Ex Grains TR UCITS ETF 1C (EUR)
— S&P GSCI® Index (EUR)



Ossiam/ Standard & Poor's, calculation by Ossiam

PERFORMANCES

29/03/2019

	MTD PERF %	YTD PERF %	Perf. 1-an %	Perf. 3-ans annualisées %	Perf. 5-ans annualisées %	Annualisée depuis la création %
Fonds	1,92	8,57	7,16	5,66	0,15	0,62
Indice	1,96	8,69	7,59	6,06	0,66	1,17
Univers d'investisse- ment	3,04	17,04	6,20	5,95	-9,04	-8,42

Ossiam/ Standard & Poor's, calculation by Ossiam

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

29.03.2019

	Volatilité annualisée %	Alpha % annualisé	BETA	Tracking Error 1-an %	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	11,42	4,60	0,47	0,03	0,05	-27,71
Index	11,43	5,16	0,47	-	0,10	-27,00
Univers d'investis- sement	19,93	-	-	-	-0,42	-57,20

Ossiam/ Standard & Poor's, calculation by 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 (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 Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR (USD)

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

Ticker Bloomberg OCMRW Index

Date de lancement 25.02.2013

Classe d'actifs Matière première

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 53 788 818

Encours de la classe d'actions EUR 41 592 802

Valeur liquidative EUR 73,130

Nombre de parts 568 750

Devise du fonds USD

Devise de la classe d'actions EUR

ISIN LU0876440578

Date de lancement 05.07.2013

Méthode de réplcation Synthétique

TER (Frais/an) 0,45%

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 CRWE FP



MATIÈRE PREMIÈRE (29.03.2019)

- Agriculture
- Énergie
- Métaux industriels
- Bétaux
- Métaux précieux

Ossiam/ Standard & Poor's, calculation by Ossiam

TOP 10 DES VALEURS (%) 29.03.2019

	Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR
S&P GSCI GOLD DYNAMIC ROLL INDEX ER	10,19
S&P GSCI LIVE CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	7,15
S&P GSCI FEEDER CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	6,83
SILVER DYNAMIC ER	5,98
S&P GSCI NATURAL GAS DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,97
S&P GSCI COPPER DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,83
S&P GSCI COTTON DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,50
S&P GSCI ALUMINUM DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,09
S&P GSCI GASOIL DYNAMIC ROLL INDEX ER	4,98
S&P GSCI ZINC DYNAMIC ROLL INDEX ER	4,46

	S&P GSCI® Index
S&P GSCI CRUDE OIL INDEX TR	17,41
S&P GSCI CORN INDEX TR	11,29
S&P GSCI LIVE CATTLE TR	9,71
S&P GSCI SOYBEAN INDEX TR	7,63
S&P GSCI COPPER INDEX TR	7,59
S&P GSCI WHEAT INDEX TR	7,07
S&P GSCI BRENT CRUDE INDEX TR	6,52
S&P GSCI GOLD INDEX TR	6,29
S&P GSCI LEAN HOGS INDEX TR	4,63
S&P GSCI HEATING OIL INDEX TR	4,13

Ossiam/ Standard & Poor's, calculation by Ossiam



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 RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 17/07/2013.

L'indice OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR 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 RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR ou de toute autre personne quant au bien-fondé d'un investissement en général en valeurs mobilières ou en particulier dans l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR ou quant à la capacité de l'indice Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index Total 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 l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR S&P à la planification de l'émission ou de la vente de l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR ou à la détermination ou au calcul de l'équation par laquelle l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR 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 l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE GARANTISSENT EN AUCUN CAS LA PERTINENCE, L'EXACTITUDE, LA VALIDITÉ OU L'EXHAUSTIVITÉ NI DE L'INDICE, NI DES DONNÉES QUI LE COMPOSENT, NI DES COMMUNICATIONS, DONT ENTRE AUTRES, LES COMMUNICATIONS VERBALES ET ÉCRITES (Y COMPRIS LES COMMUNICATIONS ÉLECTRONIQUES) QUI S'Y RAPPORTENT. S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE PEUVENT ÊTRE TENUS POUR RESPONSABLES DES DOMMAGES OU PERTES SURVENUS SUITE À DES ERREURS, OMISSIONS OU RETARDS LIÉS À L'INDICE, AUX DONNÉES ET AUX COMMUNICATIONS SUSMENTIONNÉS. S&P NE FORMULE AUCUNE GARANTIE, QU'ELLE SOIT EXPRESSE OU IMPLICITE, ET DÉNIE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE QUANT À LA QUALITÉ MARCHANDE OU À LA PERTINENCE POUR UN BUT OU UN USAGE PRÉCIS DE SES MARQUES COMMERCIALES, DE L'INDICE OU DE TOUTE DONNÉE QUI LE COMPOSE. SANS LIMITATION DE CE QUI PRÉCÈDE, S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE PEUVENT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUS POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE DOMMAGE INDIRECT, SPÉCIAL, MINEUR, PUNITIF OU IMPORTANT, DONT, SANS S'Y LIMITER, LES MANQUES À GAGNER, PERTES D'EXPLOITATION, PERTES DE TEMPS OU DÉGRADATIONS D'ACTIFS INCORPORELS, MÊME DANS LES CAS OÙ ILS ONT ÉTÉ INFORMÉS DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES, QUE CE SOIT EN VERTU D'UNE RESPONSABILITÉ CONTRACTUELLE, DÉLICTELLE, CIVILE OU AUTRE.

Standard & Poor's® and S&P®@ sont des marques déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC. « Calculated by S&P Custom Indices » et sa marque stylisée connexe sont des marques de service de Standard & Poor's Financial Services LLC pour lesquelles Ossiam a obtenu une licence d'utilisation.

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.

