

## Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (USD)

### DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

La stratégie Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector tends à offrir un profil de risque/rendement similaire à celui de l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value, mais avec un profil ESG amélioré et une empreinte carbone significativement réduite.

La stratégie repose sur le même principe que l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value, elle offre une exposition au marché action américain à travers une sélection de secteur basée sur le ratio CAPE® (Cyclically Adjusted Price to- Earnings) dans le but de sélectionner les secteurs potentiellement sous-évalués. La stratégie a pour but d'offrir une exposition aux grandes capitalisations avec un biais value, elle est destinée a des investisseurs dit « buy-and-hold » avec un horizon d'investissement long terme.

Un profil ESG amélioré : La stratégie exclut les sociétés impliquées dans la fabrication d'armes controversées, le tabac, le charbon et les controverses relatives à l'environnement, à la société et à la gouvernance.

Une empreinte carbone réduite : La stratégie, comparée à son indice initial, vise une réduction de 40% des émissions totales de gaz à effet de serre (GES), des intensités de carbone (GES / revenus des entreprises) et des émissions de GES provenant des réserves de combustibles fossiles.

Principaux bénéfices de la Stratégie :

- 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
- Une stratégie qui combine un filtre ESG et des objectifs de réduction des émissions carbonées

### PERFORMANCE DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

29.03.2019

Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (USD)  
S&P 500® Index NR (USD)



Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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                    | 2,39       | 13,71      | -            | -                         | -                         | 11,08                           |
| Univers d'investissement | 1,90       | 13,47      | 8,84         | 12,91                     | 10,39                     | 8,08                            |

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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                    | 16,32                   | 2,89              | 1,01 | -                     | 0,68            | -19,34       |
| Univers d'investissement | 15,70                   | -                 | -    | -                     | 0,51            | -19,49       |

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by Ossiam

### PROFIL DE RISQUE ET DE RENDEMENT

RISQUE PLUS FAIBLE ← → RISQUE PLUS ÉLEVÉ



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'UNIVERS D'INVESTISSEMENT

|                   |                        |
|-------------------|------------------------|
| Nom               | S&P 500® Index NR(USD) |
| Ticker Bloomberg  | SPTR500N Index         |
| Date de lancement | 31.12.1998             |
| Classe d'actifs   | Action                 |

### DONNÉES DU FONDS

|                                |  |
|--------------------------------|--|
| Dépositaire                    | BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited |
| Structure juridique            | Ossiam IRL ICAV                            |
| UCITS                          | Oui  |
| Catégorie                      | ETF géré activement                        |
| PEA                            | Non  |
| Dividendes                     | Réinvestis                                 |
| Encours total du fonds         | USD 49 565 055                             |
| Encours de la classe d'actions | USD 20 267 351                             |
| Valeur liquidative             | USD 70,311                                 |
| Nombre de parts                | 288 253                                    |
| Devise du fonds                | USD  |
| Devise de la classe d'actions  | USD  |
| ISIN                           | IE00BF92LR56                               |
| Date de lancement              | 05.04.2018                                 |
| Méthode de réplication         | Synthétique                                |
| TER (Frais/an)                 | 0,85%                                      |

### INFORMATION SUR LES

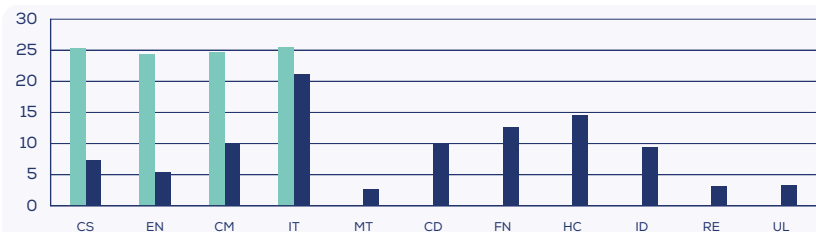
#### TRANSACTIONS

|  |   |
|--|---|
| Heure limite de réception des ordres (marché primaire)     | 15 heures (heure irlandaise) le Jour de négociation |
| Investissement minimum (marché secondaire)                 | 1 Action  |
| Ticker for London Stock Exchange<br>In fund currency (USD) |   |
| Ticker Bloomberg   | SHED LN   |
| Ticker sur Euronext Paris                                  |   |
| Ticker Bloomberg   | SHED FP   |

**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 est soumis à des risques spécifiques tels que le risque de change, d'ESG et de concentration géographique, en plus des risques de marché. Veuillez lire la section du prospectus intitulée "Risques généraux" pour de plus amples renseignements sur les risques.



**ALLOCATION  
SECTORIELLE  
(29.03.2019)**

■ Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (USD)

■ S&P 500® Index NR (USD)

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by 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

**TOP 10 DES VALEURS (%)  
29.03.2019**

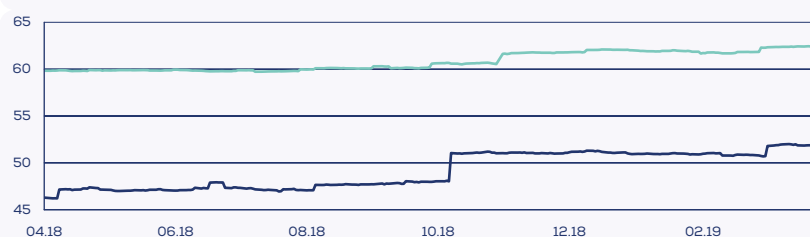
|                               | Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF | S&P 500® Index NR |
|-------------------------------|--|-------------------|
| APPLE INC                     | 4,76   | 3,60              |
| PROCTER & GAMBLE CO/<br>THE   | 4,61   | 1,10              |
| MICROSOFT CORP                | 4,61   | 3,83              |
| VERIZON<br>COMMUNICATIONS INC | 4,57   | 1,03              |
| EXXON MOBIL CORP              | 4,45   | 1,45              |
| COCA-COLA CO/THE              | 4,22   | 0,76              |
| WALT DISNEY CO/THE            | 4,12   | 0,82              |
| PEPSICO INC                   | 3,73   | 0,73              |
| AT&T INC                      | 3,52   | 0,97              |
| EOG RESOURCES INC             | 3,46   | 0,23              |

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by Ossiam

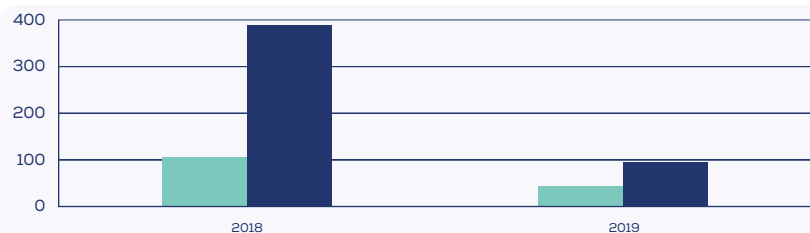
**SCORES ESG**

— Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (USD)

— S&P 500® Index NR (USD)



Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by Ossiam



**EMISSIONS GHG  
EN TCO2  
(29.03.2019)**

■ Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (USD)

■ S&P 500® Index NR (USD)

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, calculation by 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 IRL ICAV (l'« ICAV ») est un fonds à compartiments multiples constitué en tant que société d'investissement à capital variable de droit irlandais avec une responsabilité distincte entre les compartiments et autorisé par la Banque centrale d'Irlande sous le numéro C173953. L'ICAV a nommé Ossiam sa société de gestion, responsable de la gestion financière des fonds, l'administration et la distribution de l'ICAV. Ossiam, filiale de Natixis Investment Managers est agréée par l'Autorité des Marchés Financiers en qualité de Société de Gestion de Portefeuille sous le numéro GP-10000016. L'exactitude, l'exhaustivité ou la pertinence des informations provenant de sources externes ne sont pas garanties bien qu'elles aient été établies à partir de sources sérieuses, réputées fiables

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

