

## Ossiam Global Multi-Asset Risk-Control UCITS ETF 1C (EUR)

### Description de la stratégie

Le fonds Ossiam Global Multi-Asset Risk-Control a pour objectif de répliquer la performance de l'indice Global Multi-Asset Risk-Control Index calculé et publié par Solactive AG.

La stratégie vise à offrir aux investisseurs une exposition à un large éventail de classes d'actifs au travers d'un indice géré de manière à contrôler le drawdown maximum du portefeuille. Elle offre une exposition longue à un portefeuille d'actifs « risqués » combiné à un portefeuille de « liquidités » (ETFs EONIA). Le portefeuille d'actifs risqués est composé d'ETFs qui répliquent la performance d'indices actions et obligations de pays développés et émergents, obligations d'entreprises, matières premières ainsi que des indices immobiliers. L'allocation entre les classes d'actifs s'effectue selon une optimisation moyenne-variance dans laquelle les paramètres sont ajustés en fonction de la volatilité du marché des actions américaines.

La perte maximale de la stratégie est contrôlée via une allocation innovante de type CPPI (avec coussin et multiplicateur dynamique), ajustée trimestriellement, ou mensuellement en fonction de la volatilité du marché des actions américaines.

- Diversification globale à travers plusieurs classes d'actifs
- Ajustement dynamique des paramètres de risque et de l'exposition aux classes d'actifs
- Construction de portefeuille innovante de type CPPI visant à limiter la perte maximale sur 6 mois à 8% tout en évitant le risque de monétisation

### PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

— Ossiam Global Multi-Asset Risk-Control UCITS ETF 1C (EUR)  
— EONIA Total Return Index (EUR)



Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Solactive AG

### PERFORMANCES NETTES

	Perf. 1 mois %	Perf. depuis Jan. %	Perf. 1 an %	Perf. 3-ans annualisée %	Perf. 5-ans annualisée %	Annualisée depuis la création %
Fonds	-0,08	-6,43	-7,14	-1,40	-	-0,02
Indice	0,02	-5,35	-5,65	-0,05	-	1,31
Eonia	-0,04	-0,31	-0,46	-0,40	-0,36	-0,39

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Solactive AG

### PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité annualisée %	Alpha % annualisé	Beta	Tracking Error 1 an %	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	5,36	5,57	14,36	0,20	0,07	-15,32
Indice	5,36	5,77	11,43	-	0,32	-14,90
Eonia	0,02	-	-	-	-	-1,42

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Solactive AG

**Informations importantes:** Les performances sont nettes des frais de gestion. 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 marché 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 indicial, le risque de change, le risque lié aux instruments dérivés et aux contreparties en plus du **risque de perte en capital** et du risque de marché. Veuillez lire la section du prospectus intitulée "Risques généraux" pour de plus amples renseignements sur les risques.

Veuillez noter que si la devise du fonds/classe d'actions est différente de la devise locale de l'investisseur, les variations du taux de change entre les deux devises affecteront les pertes ou gains générés par le fonds ou la classe d'actions.

### 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	Global Multi-Asset Risk-Control Index (EUR)
Eonia	EONIA Total Return Index (EUR)
Ticker Bloomberg	CBKIGMRC Index
Date de lancement	23.11.2016
Classe d'actifs	Multi Asset
Fréquence de rebalancement	Trimestrielle (avec un rebalancement additionnel optionnel)

### DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Structure juridique	Compartment d'Ossiam Lux SICAV
UCITS	Oui
PEA	Oui
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	EUR 198 332 753
Encours de la classe d'actions	EUR 198 332 753
Valeur liquidative	EUR 267,447
Nombre de parts	741 577
Devise du fonds	EUR
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU1446552496
Date de lancement	28.12.2016
Méthode de réplification	Synthétique
TER (Frais/an)	0,55%

### INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire <sup>1</sup> )	17h00 heure de Luxembourg (J-1)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
<sup>1</sup> Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités	
XETRA en EUR	OSXM GY
Euronext Paris en EUR	GMRC FP

## ALLOCATION DU PORTEFEUILLE



■ Actions Internationales	11.66%
■ ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD DIST	7.16%
■ ISHARES EURO STOXX 50 UCITS ETF DE	4.49%
■ Taux	31.95%
■ ISHARES CORE EUR GOVT BOND UCITS ETF	8.12%
■ ISHARES CORE UK GILTS UCITS ETF GBP DIST	7.95%
■ ISHARES CORE EUR CORP BOND UCITS ETF EUR DIST	6.49%
■ ISHARES J.P. MORGAN USD EM BOND UCITS ETF USD DIST	4.39%
■ ISHARES USD CORP BOND UCITS ETF USD DIST	4.27%
■ SPDR BARCLAYS U.S. TREASURY BOND UCITS ETF	0.74%
■ Cash	56.39%
■ DB X-TRACKERS II EONIA UCITS ETF	18.80%
■ LYXOR EURO CASH UCITS ETF	18.80%
■ COMSTAGE ETF COMMERZBANK EONIA INDEX TR UCITS ETF	18.79%

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Solactive AG

## TOP 10 DES VALEURS CONSTITUTIVES DE L'INDICE (%)

	Global Multi-Asset Risk-Control Index
DB X-TRACKERS II EONIA UCITS ETF	18,80
LYXOR EURO CASH UCITS ETF	18,80
COMSTAGE ETF COMMERZBANK EONIA INDEX TR UCITS ETF	18,79
ISHARES CORE EUR GOVT BOND UCITS ETF	8,12
ISHARES CORE UK GILTS UCITS ETF GBP DIST	7,95
ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD DIST	7,16
ISHARES CORE EUR CORP BOND UCITS ETF EUR DIST	6,49
ISHARES EURO STOXX 50 UCITS ETF DE	4,49
ISHARES J.P. MORGAN USD EM BOND UCITS ETF USD DIST	4,39
ISHARES USD CORP BOND UCITS ETF USD DIST	4,27

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Solactive AG

## 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 Bank International GmbH, Luxembourg Branch, 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, est agréée par l'Autorité des Marchés Financiers en qualité de Société de Gestion de Portefeuille sous le numéro GP-10000016. La société de gestion Ossiam, dont le siège social est situé au 6 place de la Madeleine - 75008 Paris, est immatriculée au RCS de Paris sous le n° 512 855 958.

Le fonds OSSIAM GLOBAL MULTI-ASSET RISK-CONTROL (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 05/01/2017.

Ni Commerzbank Aktiengesellschaft ni ses filiales (collectivement « Commerzbank ») ne sont ni l'émetteur ni le producteur d'Ossiam Global Multi-Asset Risk-Control ETF (l'« ETF »). Commerzbank n'a aucune responsabilité, obligation ou devoir à l'égard des investisseurs de l'ETF. Le Global Multi Asset Risk Control Index (l'Indice) est concédé sous licence par OSSIAM (l'Émetteur) en tant qu'émetteur de l'ETF. La seule relation de Commerzbank avec l'Émetteur concernant l'ETF est la concession sous licence de l'Indice, qui est déterminée, composée et calculée par Commerzbank, ou ses successeurs, sans considération pour l'Émetteur ou l'ETF ou ses propriétaires. L'ETF n'est ni sponsorisé, promu ou vendu par Commerzbank ou une tierce partie impliquée d'une manière ou d'une autre dans la compilation, le calcul ou la création de l'Indice. Commerzbank n'accorde aucune garantie, explicite ou non, quant à la pertinence d'investir dans l'ETF ou dans des titres en général ou la capacité de l'Indice à suivre la performance du marché correspondant ou de référence. Commerzbank n'a pas étudié la légalité ou le profil de l'ETF pour quelque personne ou entité que ce soit. Commerzbank n'a pas pris part à la fixation du calendrier, des prix ou des quantités de l'ETF qui sera émis ni n'en assume la responsabilité. Commerzbank n'est pas tenu de prendre en compte les besoins de l'Émetteur ou des propriétaires de l'ETF ou d'une autre tierce partie dans la détermination, la composition ou le calcul de l'Indice. Commerzbank n'a pas l'obligation d'administrer, de commercialiser ni de négocier l'ETF. NI COMMERZBANK NI SES DONNEURS DE LICENCE NE SONT RESPONSABLES ENVERS L'ÉMETTEUR, LES INVESTISSEURS OU D'AUTRES TIERS DE LA QUALITÉ, LA VÉRACITÉ ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE L'INDICE OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCLUSES OU DES INTERRUPTIONS DANS LA LIVRAISON DE L'INDICE. COMMERZBANK N'APPORTE AUCUNE GARANTIE, EXPLICITE OU NON, CONCERNANT LES RÉSULTATS QUI PEUVENT ÊTRE OBTENUS PAR L'ÉMETTEUR, DES INVESTISSEURS OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ EN UTILISANT L'INDICE OU LES DONNÉES QUI Y SONT INCLUSES. COMMERZBANK NE DONNE AUCUNE GARANTIE CONCERNANT LA VALEUR MARCHANDE OU L'ADÉQUATION À UNE FIN PARTICULIÈRE DE L'INDICE OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCLUSES. COMMERZBANK SE RÉSERVE LE DROIT DE MODIFIER LES MÉTHODES DE CALCUL OU DE PUBLICATION, OU DE CESSER LE CALCUL OU LA PUBLICATION DE L'INDICE. COMMERZBANK N'EST EN AUCUN CAS RESPONSABLE DES ERREURS DE CALCUL OU DES ERREURS, DES RETARDS OU DE L'INTERRUPTION DE LA PUBLICATION DE L'INDICE. LA RESPONSABILITÉ DE COMMERZBANK NE PEUT ÊTRE ENGAGÉE POUR LES DOMMAGES, DONT, SANS S'Y LIMITER, LES DOMMAGES INDIRECTS ET PARTICULIERS, OU LES ÉVENTUELS MANQUES À GAGNER, QUAND BIEN MÊME ILS AURAIENT ÉTÉ PORTÉS À SA CONNAISSANCE, RÉSULTANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE OU DES DONNÉES QUI Y SONT INCLUSES OU CONCERNANT L'ETF OU AUTRE.

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.

Pour plus d'informations sur la méthodologie de l'indice : <https://www.ossiam.com/strategies/see>

Le présent document est fourni uniquement à des fins d'information aux prestataires de services d'investissement ou aux autres Clients Professionnels ou Investisseurs Qualifiés et, lorsque la réglementation locale l'exige, uniquement sur demande écrite de leur part. Le présent document ne peut pas être utilisé auprès des clients non-professionnels. Il relève de la responsabilité de chaque prestataire de services d'investissement de s'assurer que l'offre ou la vente de titres de fonds d'investissement ou de services d'investissement de tiers à ses clients respecte la législation nationale applicable.

**En France:** Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers International - Société de gestion de portefeuilles agréée par l'Autorité des Marchés Financiers sous le n° GP 90-009, société anonyme immatriculée au RCS de Paris sous le numéro 329 450 738. Siège social: 43 avenue Pierre Mendès France, 75013 Paris.

**Au Luxembourg:** Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers S.A. - Société de gestion luxembourgeoise agréée par la Commission de Surveillance du Secteur Financier, société anonyme immatriculée au RCS de Luxembourg sous le numéro B115843, 2, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg.

**En Belgique:** Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers S.A., Belgian Branch, Louizalaan 120 Avenue Louise, 1000 Brussel/Bruxelles, Belgium.

**En Suisse:** Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers, Switzerland Sàrl, Rue du Vieux Collège 10, 1204 Genève, Suisse ou son bureau de représentation à Zurich, Schweizergasse 6, 8001 Zürich.

Les entités susmentionnées sont des unités de développement commercial de Natixis Investment Managers, la holding d'un ensemble divers d'entités de gestion et de distribution de placements spécialisés présentes dans le monde entier. Les filiales de gestion et de distribution de Natixis Investment Managers mènent des activités réglementées uniquement dans et à partir des pays où elles sont autorisées. Les services qu'elles proposent et les produits qu'elles gèrent ne s'adressent pas à tous les investisseurs dans tous les pays.

Bien que Natixis Investment Managers considère les informations fournies dans le présent document comme fiables, y compris celles des tierces parties, elle ne garantit pas l'exactitude, l'adéquation ou le caractère complet de ces informations.

La remise du présent document et/ou une référence à des valeurs mobilières, des secteurs ou des marchés spécifiques dans le présent document ne constitue en aucun cas un conseil en investissement, une recommandation ou une sollicitation d'achat ou de vente de valeurs mobilières, ou une offre de services. Les investisseurs doivent examiner attentivement les objectifs d'investissements, les risques et les frais relatifs à tout investissement avant d'investir. Les analyses et les opinions mentionnées dans le présent document représentent le point de vue de (des) l'auteur (s) référencé(s). Elles sont émises à la date indiquée, sont susceptibles de changer et ne sauraient être interprétées comme possédant une quelconque valeur contractuelle.

Le présent document ne peut pas être distribué, publié ou reproduit, en totalité ou en partie.

Tous les montants indiqués sont exprimés en USD, sauf indication contraire.