

Ossiam Japan Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

Description de la stratégie

Le fonds Ossiam Japan Minimum Variance NR a pour objectif de refléter la performance de l'indice Japan Minimum Variance NR calculé et publié par S&P Dow Jones Indices LLC.

La stratégie vise à réduire la volatilité de l'univers d'investissement tout en maintenant un niveau élevé de diversification. Elle prend en compte les estimations de volatilité des actions ainsi que leur corrélation afin de construire un portefeuille « long only » défensif.

Cette approche est adaptée aux investisseurs recherchant une exposition sur le long terme avec une volatilité réduite par rapport à celle du marché.

- Exposition au marché des actions japonaises
- Objectif de réduction de la volatilité
- Bénéficie de l'anomalie de faible volatilité

PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

— Ossiam Japan Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)
— S&P/TOPIX 150 Net TR Index (EUR)



Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Standard & Poor's

PERFORMANCES NETTES

	Perf. 1 mois %	Perf. depuis Jan. %	Perf. 1 an %	Perf. 3-ans annualisée %	Perf. 5-ans annualisée %	Annualisée depuis la création %
Fonds	4,53	-9,75	-4,24	2,19	-	3,11
Indice	4,59	-9,53	-3,85	2,77	-	3,81
Univers d'investissement	6,76	-7,24	1,65	4,36	-	4,23

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Standard & Poor's

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité annualisée %	Alpha % annualisé	Beta	Tracking Error 1 an %	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	15,80	-0,31	0,81	0,18	0,22	-24,75
Indice	15,81	0,39	0,81	-	0,26	-24,70
Univers d'investissement	18,33	-	-	-	0,25	-26,41

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Standard & Poor's

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 indicel, le risque de concentration géographique 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. Cette classe en EUR n'est pas couverte contre le risque de change. 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	Japan Minimum Variance Index NR (JPY)
Univers d'investissement	S&P/TOPIX 150 Net TR Index (JPY)
Ticker Bloomberg	JPMVNR Index
Date de lancement	05.10.2015
Classe d'actifs	Action
Fréquence de rebalancement	Mensuelle

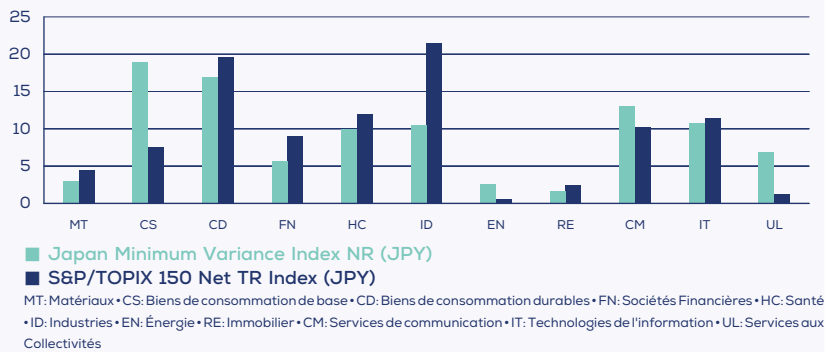
DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Structure juridique	Compartment d'Ossiam Lux SICAV
UCITS	Oui
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	JPY 1 563 707 711
Encours de la classe d'actions	EUR 12 329 690
Valeur liquidative	EUR 99,209
Nombre de parts	124 280
Devise du fonds	JPY
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU1254453738
Date de lancement	21.12.2015
Méthode de réplcation	Physique
TER (Frais/an)	0,65%

INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire ¹)	17h00 en J-1 (heure du Luxembourg)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
¹ Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités	
XETRA en EUR	OSXJ GY
Euronext Paris en EUR	JPMV FP
Borsa Italiana en EUR	JPMV IM

ALLOCATION SECTORIELLE



Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Standard & Poor's

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

	Japan Minimum Variance Index NR	S&P/TOPIX 150 Net TR Index
NINTENDO CO LTD	4,18	2,00
PAN PACIFIC INTERNATIONAL HOLD	3,80	0,45
MEIJI HOLDINGS CO LTD	3,48	0,37
NTT DOCOMO INC	2,89	1,02
NISSIN FOODS HOLDINGS CO LTD	2,83	0,27
NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	2,79	1,76
NITORI HOLDINGS CO LTD	2,70	0,56
JXTG HOLDINGS INC	2,60	0,40
AJINOMOTO CO INC	2,57	0,32
CHUBU ELECTRIC POWER CO INC	2,39	0,28

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Standard & Poor's

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. 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 JAPAN MINIMUM VARIANCE NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 07/01/2016. OSSIAM a conclu un contrat avec S&P Opco LLC, une filiale de S&P Dow Jones Indices, pour le calcul et la mise à jour des indices JAPAN MINIMUM VARIANCE NR et JAPAN MINIMUM VARIANCE EURO HEDGED NR (« les Indices »). Les Indices ne sont aucunement financés par S&P Dow Jones Indices LLC ou ses filiales ou fournisseurs de licences tiers, dont Standard & Poor's Financial Services LLC et Dow Jones Trademark Holdings LLC (ensemble « S&P Dow Jones Indices »). S&P Dow Jones Indices se dégage de toute responsabilité pour toute erreur ou omission dans le calcul des Indices. « Calculated by S&P Dow Jones Indices » et sa ou ses marque(s) stylisée(s) connexe(s) sont des marques de service de S&P Dow Jones Indices pour lesquelles Ossiam a obtenu une licence d'utilisation. S&P® est une marque déposée de Standard & Poor's Financial Services LLC, et Dow Jones® est une marque déposée de Dow Jones Trademark Holdings LLC. S&P DOW JONES INDICES NE GARANTIT EN AUCUN CAS LA PERTINENCE, L'EXACTITUDE, LA VALIDITÉ ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE Y AFFÉRENTE, OU DE TOUTE COMMUNICATION Y AFFÉRENTE, DONT ENTRE AUTRES, LES COMMUNICATIONS VERBALES, ÉCRITES ET ÉLECTRONIQUES. S&P DOW JONES INDICES NE PEUT ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE DES DOMMAGES OU PERTES SURVENUS SUITE À DES ERREURS, OMISSIONS OU RETARDS LIÉS AUX INDICES, AUX DONNÉES ET AUX COMMUNICATIONS SUSMENTIONNÉS. S&P DOW JONES INDICES 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, OU QUANT AUX RÉSULTATS À OBTENIR PAR OSSIAM, PAR LES ACTIONNAIRES DU FONDS OU PAR TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ DE PAR L'UTILISATION DES INDICES OU DE TOUTE DONNÉE Y AFFÉRENTE. SANS LIMITATION DE CE QUI PRÉCÈDE, S&P DOW JONES INDICES NE PEUT EN AUCUN CAS ÊTRE TENU POUR RESPONSABLE 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, DÉLICTUELLE, CIVILE 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.