

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

Description de la stratégie

Le fonds Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR vise à répliquer la performance de l'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR calculé et publié par Bloomberg Index Services Limited. La stratégie est une stratégie systématique de type « value » fondée sur les travaux du Professeur Robert Shiller. Elle offre une exposition aux actions européennes 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 européennes 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 (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

— Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)
 — MSCI Europe Net Return Index (EUR)



Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, MSCI

PERFORMANCES NETTES

	Perf. 1 mois %	Perf. depuis Jan. %	Perf. 1 an %	Perf. 3-ans annualisée %	Perf. 5-ans annualisée %	Annualisée depuis la création %
Fonds	4,24	-6,64	-1,01	2,37	3,81	4,08
Indice	4,28	-6,35	-0,49	2,91	4,43	4,73
Univers d'investissement	3,59	-11,00	-2,31	1,63	2,70	3,78

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, MSCI

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité annualisée %	Alpha % annualisé	Beta	Tracking Error 1 an %	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	18,71	0,44	0,96	0,06	0,24	-33,03
Indice	18,72	1,09	0,96	—	0,27	-33,05
Univers d'investissement	18,74	—	—	—	0,22	-35,25

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, MSCI

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 indiciel, 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	Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (EUR)
Univers d'investissement	MSCI Europe Net Return Index (EUR)
Ticker Bloomberg	BXIIESE Index
Date de lancement	29.08.2013
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	Oui
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	EUR 33 620 662
Encours de la classe d'actions	EUR 33 620 662
Valeur liquidative	EUR 333,231
Nombre de parts	100 893
Devise du fonds	EUR
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU1079842321
Date de lancement	30.12.2014
Méthode de réplification	Synthétique
TER (Frais/an)	0,65%

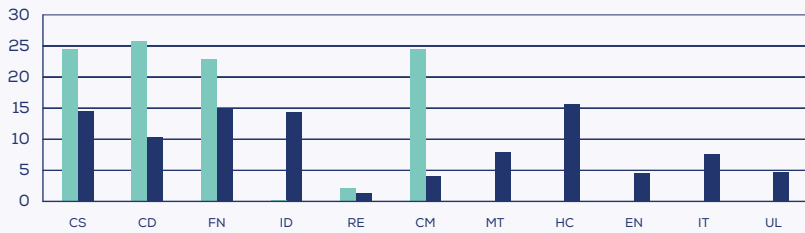
INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire ¹)	14h45 (heure de Luxembourg)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action

¹Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités

London Stock Exchange en EUR	CAPE LN
London Stock Exchange en GBP	LCPE LN
XETRA en EUR	EUPE GY
Euronext Paris en EUR	CAPE FP
SIX Swiss Exchange en EUR	CAPE SW
Borsa Italiana en EUR	CAPE IM

ALLOCATION SECTORIELLE



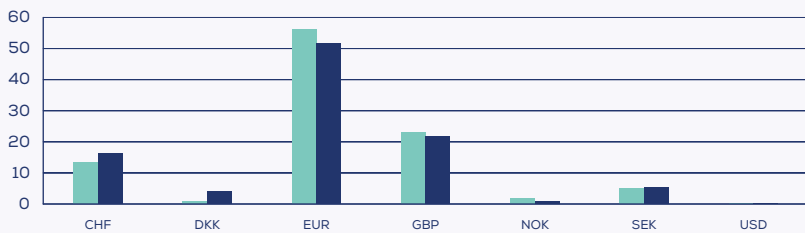
■ Shiller Barclays CAPE@ Europe Sector Value Net TR Index (EUR)

■ MSCI Europe Net Return Index (EUR)

MT: Matériaux • CS: Biens de consommation de base • CD: Biens de consommation durables • FN: Sociétés Financières • HC: Santé • ID: Industries • EN: Énergie • RE: Immobilier • CM: Services de communication • IT: Technologies de l'information • UL: Services aux Collectivités

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, MSCI

ALLOCATION PAR DEVISES



■ Shiller Barclays CAPE@ Europe Sector Value Net TR Index (EUR)

■ MSCI Europe Net Return Index (EUR)

CHF: Franc Suisse • DKK: Couronne danoise • EUR: Euro • GBP: Livre Sterling • NOK: Couronne Norvégienne • SEK: Couronne Suédoise • USD: Dollar américain

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, MSCI

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

	Shiller Barclays CAPE@ Europe Sector Value Net TR Index	MSCI Europe Net Return Index
NESTLE SA	6,88	4,07
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	4,09	0,67
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,72	1,48
VODAFONE GROUP PLC	2,74	0,45
UNILEVER NV	1,64	0,96
VIVENDI	1,63	0,27
ADIDAS AG	1,63	0,66
L'OREAL SA	1,59	0,94
ALLIANZ SE-REG	1,58	1,03
ORANGE	1,56	0,25

Données calculées par Ossiam au 28.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, MSCI

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 du 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 SHILLER BARCLAYS CAPE@ EUROPE SECTOR VALUE TR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 19/01/2015. Pour les investisseurs basés en Suisse : le représentant des fonds et agent payeur en Suisse est RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Succursale de Zurich, Bleicherweg 7, 8027 Zurich.

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

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.