

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

### Description de la stratégie

Le fonds Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR vise à répliquer la performance de l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR calculé et publié par Bloomberg Index Services Limited. Le processus d'investissement du fonds est systématique de type « value » fondé sur les travaux du Professeur Robert Shiller. La stratégie offre une exposition aux actions américaines 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 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

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

— Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)  
— S&P 500® Index NR (EUR)



Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, 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                    | 5,07           | -0,21               | 7,24         | 12,15                    | 13,74                    | 12,13                           |
| Indice                   | 5,09           | 0,05                | 7,74         | 12,89                    | 14,36                    | 12,73                           |
| Univers d'investissement | 5,93           | 2,61                | 11,63        | 13,61                    | 12,28                    | 10,65                           |

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

### PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

|                          | Volatilité annualisée % | Alpha % annualisé | Beta | Tracking Error 1 an % | Ratio de Sharpe | Perte max. % |
|--------------------------|-------------------------|-------------------|------|-----------------------|-----------------|--------------|
| Fonds                    | 21,44                   | 1,43              | 1,00 | 0,06                  | 0,58            | -34,48       |
| Indice                   | 21,46                   | 2,03              | 1,00 | —                     | 0,61            | -34,50       |
| Univers d'investissement | 21,04                   | —                 | —    | —                     | 0,52            | -33,63       |

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, 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 indicial, le risque lié aux instruments dérivés et aux contreparties, 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                        | Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index (USD) |
| Univers d'investissement   | S&P 500® Index NR (USD)                                   |
| Ticker Bloomberg           | BXIIICUSU Index   |
| Date de lancement          | 05.10.2012  |
| Classe d'actifs            | Action  |
| Fréquence de rebalancement | Mensuelle   |

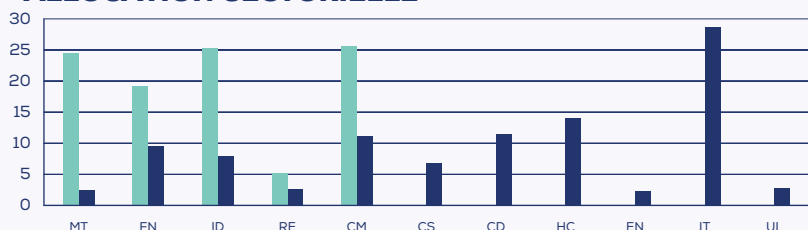
## DONNÉES DU FONDS

|                                |   |
|--------------------------------|---|
| 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         | USD 1 756 988 326                                       |
| Encours de la classe d'actions | EUR 433 466 428   |
| Valeur liquidative             | EUR 697,647   |
| Nombre de parts                | 621 326   |
| Devise du fonds                | USD   |
| Devise de la classe d'actions  | EUR   |
| ISIN                           | LU1079841273  |
| Date de lancement              | 22.06.2015  |
| Méthode de réplication         | Synthétique   |
| TER (Frais/an)                 | 0,65%   |

## INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

|   |                             |
|---|-----------------------------|
| Heure limite de réception des ordres (marché primaire <sup>1</sup> )  | 16h00 (heure de Luxembourg) |
| Investissement minimum (marché secondaire)  | 1 Action                    |
| <sup>1</sup> Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités |                             |
| XETRA en EUR  | USCP GY                     |
| Euronext Paris en EUR   | CAPU FP                     |
| SIX Swiss Exchange en EUR   | CAPU SW                     |
| Borsa Italiana en EUR   | CAPU IM                     |

## ALLOCATION SECTORIELLE



■ Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index (USD)

■ S&P 500® Index NR (USD)

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 31.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's

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

|                              | Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index | S&P 500® Index NR |
|------------------------------|---|-------------------|
| FACEBOOK INC-A               | 6,17  | 2,44              |
| LINDE PLC                    | 4,46  | 0,45              |
| ALPHABET INC-CL A            | 2,94  | 1,69              |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 2,93  | 1,46              |
| ALPHABET INC-CL C            | 2,87  | 1,65              |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 2,20  | 0,22              |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 2,11  | 1,05              |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 1,84  | 0,19              |
| NEWMONT MINING CORP          | 1,84  | 0,19              |
| ECOLAB INC                   | 1,66  | 0,17              |

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Barclays, 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 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® US SECTOR VALUE TR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 01/07/2015.

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