

Ossiam Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit UCITS ETF 1C (EUR)

Description de la stratégie

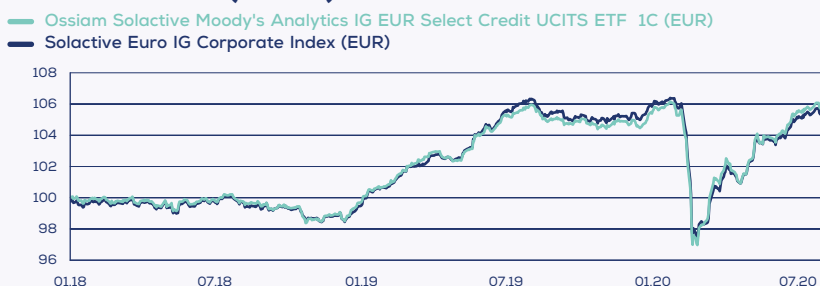
La stratégie Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit suit la performance d'une sélection de 100 obligations, parmi les composants de l'indice Solactive Euro IG Corporate, en s'appuyant sur des mesures quantitatives calculées par Moody's Analytics.

La stratégie construit un portefeuille équilibré de 100 obligations qui, selon les mesures quantitatives établies par Moody's Analytics, figurent parmi la partie la plus liquide de l'univers d'investissement, apparaissent sous évaluées, et ont une probabilité de défaut faible, en se basant sur la mesure EDFTM de Moody's Analytics. Elle attribue un poids maximal de 5% par émetteur.

Cette sélection est neutre en durée et en allocation sectorielle (exposition aux secteurs financiers et non financiers) par rapport à son univers d'investissement et est revue trimestriellement.

- réduire les inefficiences présentes sur les indexations classiques du marché obligataires
- maintenir un risque de crédit réduit
- maximiser le rendement d'une sélection liquide et diversifiée d'obligations d'entreprises Investment Grade libellées en Euro

PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT



Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive

PERFORMANCES NETTES

	Perf. 1 mois %	Perf. depuis Jan. %	Perf. 1 an %	Perf. 3-ans annualisée %	Perf. 5-ans annualisée %	Annualisée depuis la création %
Fonds	0,12	0,93	-0,27	-	-	1,96
Indice	0,17	1,29	0,28	-	-	2,48
Univers d'investissement	0,14	0,29	-0,96	1,85	2,52	1,93

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité annualisée %	Alpha % annualisé	Beta	Tracking Error 1 an %	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	2,95	0,04	0,99	0,04	0,80	-8,65
Indice	2,95	0,56	0,99	-	0,98	-8,60
Univers d'investissement	2,91	-	-	-	0,80	-8,53

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive

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, le risque de crédit, le risque de concentration géographique, le risque lié à la concentration du portefeuille 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	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index (EUR)
Univers d'investissement	Solactive Euro IG Corporate Index (EUR)
Ticker Bloomberg	SOLMASC Index
Date de lancement	22.11.2017
Classe d'actifs	Fixed Income
Fréquence de rebalancement	Trimestriel

DONNÉES DU FONDS

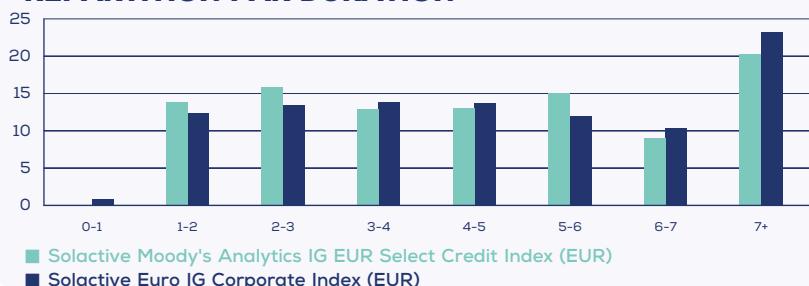
Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Structure juridique	Compartiment d'Ossiam Lux SICAV
UCITS	Oui
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	EUR 49 456 079
Encours de la classe d'actions	EUR 49 456 079
Valeur liquidative	EUR 188,406
Nombre de parts	262 497
Devise du fonds	EUR
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU1093307442
Date de lancement	29.12.2017
Méthode de réplification	Synthétique
TER (Frais/an)	0,35%

INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire ¹)	15h45 (heure de Luxembourg)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
XETRA en EUR	OSXF GY
Euronext Paris en EUR	MOOC FP

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

RÉPARTITION PAR DURATION



Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive

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

	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index	Solactive Euro IG Corporate Index
TMO 1 7/8 10/01/49	1,05	0,04
UCGIM 2.731 01/15/32	1,05	0,05
BOND ASSICURAZIONI GENERALI 2026-05-04 4.125	1,05	0,04
ASSGEN 5 06/08/48	1,04	0,04
ASSGEN 5 1/2 10/27/47	1,04	0,06
UCGIM 4 7/8 02/20/29	1,03	0,04
ACAFP 4 3/4 09/27/48	1,03	0,05
DHR 1.8 09/18/49	1,02	0,03
MO 3 1/8 06/15/31	1,02	0,05
AXASA 3 1/4 05/28/49	1,02	0,09

CARACTÉRISTIQUES DU PORTEFEUILLE

	Solactive Moody's Analytics IG EUR Select Credit Index	Solactive Euro IG Corporate Index
Duration (en année)	5,30	5,25
Duration Ajustée (en année)	5,26	5,21
EDF (Expected Default Frequency) %	NaN	NaN
Yield to Maturity %	0,76	0,62

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Moody's Analytics, Solactive

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.

« L'instrument financier n'est ni sponsorisé, promu, vendu ou soutenu de quelque manière que ce soit par Solactive AG qui n'apporte aucune garantie, explicite ou implicite, concernant les résultats obtenus en utilisant l'Indice et/ou la marque de commerce de l'Indice ou le Cours de l'Indice à quelque moment que ce soit ou à tout autre égard. L'Indice est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait tout son possible pour assurer que l'Indice est calculé correctement. Quelles que soient ses obligations envers l'Émetteur, Solactive AG n'est pas tenu d'informer les tierces parties, dont les investisseurs et/ou les intermédiaires financiers de l'instrument, des erreurs identifiées dans l'Indice. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG ni la concession sous licence de la marque de l'Indice dans le but de l'utiliser avec l'instrument financier ne saurait constituer une recommandation de Solactive AG d'investir du capital dans ledit instrument financier ni ne représente une garantie ou une opinion de Solactive AG concernant quelque placement que ce soit dans cet instrument financier. »

« Le Fonds n'est ni sponsorisé, promu, vendu ou soutenu de quelque manière que ce soit par Moody's Analytics qui n'apporte aucune garantie, explicite ou implicite, concernant les résultats obtenus en utilisant l'Indice et/ou la marque de commerce ou les données Moody's Analytics à quelque moment que ce soit ou à tout autre égard. Certaines données financières quantitatives utilisées par Solactive AG pour le calcul et la publication de l'Indice sont fournies par Moody's Analytics. Quelles que soient ses obligations envers l'Émetteur et Solactive AG, Moody's Analytics n'est pas tenu d'informer les tierces parties, dont les investisseurs et/ou les intermédiaires financiers du Fonds, des erreurs identifiées dans les données. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG ni la concession sous licence de données ou de la marque Moody's Analytics dans le but de l'utiliser avec l'Indice et le Fonds ne saurait constituer une recommandation de Moody's Analytics d'investir du capital dans ledit Fonds ni ne représente une garantie ou une opinion de Moody's Analytics concernant quelque placement que ce soit dans ce Fonds. »

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.