

## Ossiam US Steepener UCITS ETF 1C (USD)

### Description de la stratégie

La stratégie Ossiam US Steepener vise à répliquer la performance de l'indice Solactive US Treasury Yield Curve Steepener 2-5 vs 10-30. L'indice est investi dans des contrats à terme sur des bons du Trésor américain et est conçu pour bénéficier d'une éventuelle augmentation de la pente des taux d'intérêt américains, ou courbe des taux, tout en limitant la sensibilité à un mouvement parallèle de la courbe des taux de rendement.

La pente des taux d'intérêt américains correspond à l'écart entre les taux long terme (10 et 30 ans) et les taux court terme (2 et 5 ans). Pour bénéficier d'une augmentation de la pente, l'indice achète des contrats à terme les taux courts et vend des contrats à terme sur les taux longs.

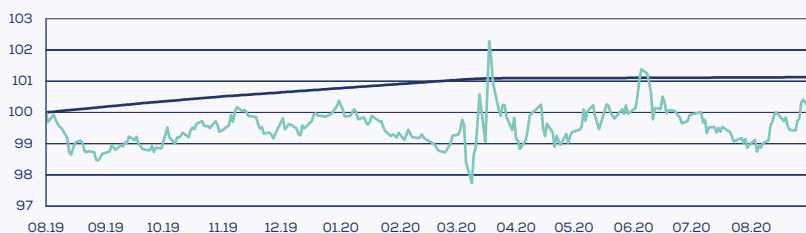
Pour limiter la sensibilité du portefeuille à un mouvement parallèle de la courbe des taux, la jambe « acheteuse » sur les contrats court terme et la jambe « vendeuse » sur les contrats long terme sont ajustées lors de chaque rebalancement pour obtenir un portefeuille de durée neutre.

La stratégie :

- Fournir une exposition neutre en durée à la pente des taux d'intérêt américains ;
- Viser à bénéficier d'une éventuelle augmentation de la pente des taux d'intérêt américains.

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

Ossiam US Steepener UCITS ETF 1C (USD)\*\*  
Fed Funds (USD)



Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. 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	1,20	-0,23	1,50	-	-	0,14
Indice	1,25	0,15	2,11	-	-	0,73
Univers d'investissement	0,01	0,35	0,96	-	-	1,04

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. 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	4,95	-	-	0,03	-0,19	-3,47
Indice	4,95	-	-	-	-0,07	-3,36
Univers d'investissement	0,07	-	-	-	-	0,00

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. 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 lié aux instruments dérivés et aux contreparties, le risque de crédit, le risque lié à l'effet de levier, 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 US Treasury Yield Curve Steepener 2-5 vs 10-30 Index (USD)
Univers d'investissement	Fed Funds (USD)
Ticker Bloomberg	SOUSTFTT Index
Date de lancement	09.05.2019
Classe d'actifs	Fixed Income
Fréquence de rebalancement	Trimestriel

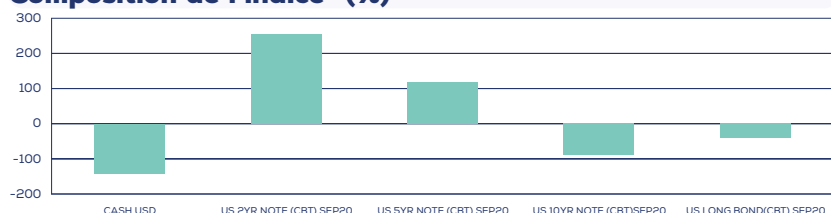
### DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Structure juridique	Compartment d'Ossiam Lux SICAV UCITS
UCITS	Oui
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	USD 172 685 374
Encours de la classe d'actions	USD 16 878 985
Valeur liquidative	USD 128,764
Nombre de parts	131 085
Devise du fonds	USD
Devise de la classe d'actions	USD
ISIN	LU1965301184
Date de lancement	01.08.2019
Méthode de réplcation	Synthétique
TER (Frais/an)	0,30%

### INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire <sup>1</sup> )	16h00 (heure luxembourgeoise)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
<sup>1</sup> Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités	
XETRA en EUR	USTP GY

## Composition de l'indice\* (%)



\*Les pondérations négatives reflètent une position vendeuse de l'indice sur ces actifs  
Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Solactive AG

## Différence historique entre les taux longs<sup>1</sup> et les taux courts<sup>2</sup> américains



<sup>1</sup>moyenne entre les taux américains 10 ans et 30 ans. <sup>2</sup>moyenne entre les taux américains 2 ans et 5 ans.  
Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. 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 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. »

Pour plus d'information 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.