

## Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

### Description de la stratégie

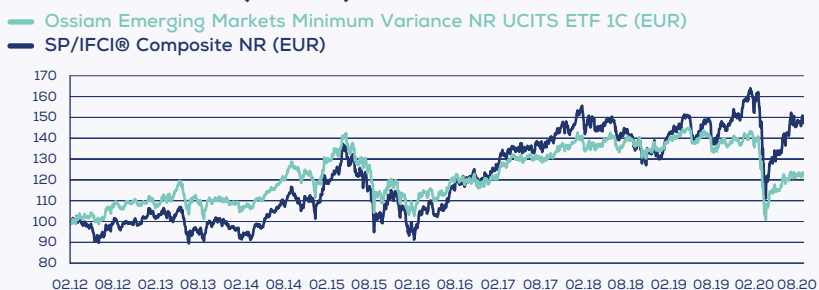
Le fonds Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR a pour objectif de répliquer la performance de l'indice Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index Net Return calculé et publié par Standard & Poor's.

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 leurs corrélations 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 des pays émergents
- Objectif de réduction de la volatilité
- Bénéficie de l'anomalie de faible volatilité

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



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	-0,18	-13,49	-11,13	-2,47	1,31	2,32
Indice	-0,02	-12,44	-9,48	-0,78	3,02	4,07
Univers d'investissement	1,06	-6,72	3,92	2,13	7,19	4,61

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	13,34	-1,18	0,76	0,08	0,19	-30,36
Indice	13,35	0,57	0,76	-	0,32	-29,53
Univers d'investissement	15,99	-	-	-	0,30	-33,50

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 indiciel, le risque lié aux instruments dérivés et aux contreparties, le risque lié aux pays émergents 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	Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)
Univers d'investissement	SP/IFCI® Composite NR (USD)
Ticker Bloomberg	OEMMVNR Index
Date de lancement	24.01.2012
Classe d'actifs	Action
Fréquence de rebalancement	Semestrielle

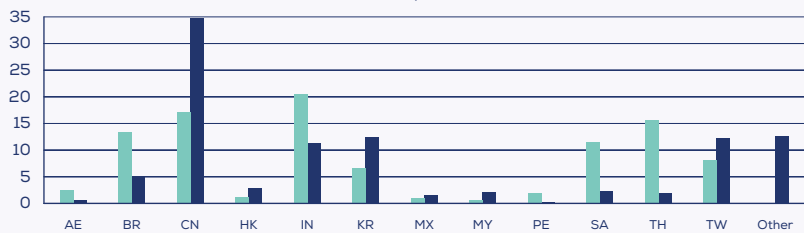
## DONNÉES DU FONDS

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 116 748 696
Encours de la classe d'actions	EUR 93 143 239
Valeur liquidative	EUR 97,066
Nombre de parts	959 587
Devise du fonds	USD
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	LU0705291903
Date de lancement	03.02.2012
Méthode de réplcation	Synthétique
TER (Frais/an)	0,75%

## INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire <sup>1</sup> )	16h00 heure de Luxembourg (J-1)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
<sup>2</sup> Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités	
XETRA en EUR	OSX9 GR
Euronext Paris en EUR	EMMV FP
SIX Swiss Exchange en EUR	EMMV SW
Borsa Italiana en EUR	EMMV IM

## ALLOCATION GÉOGRAPHIQUE



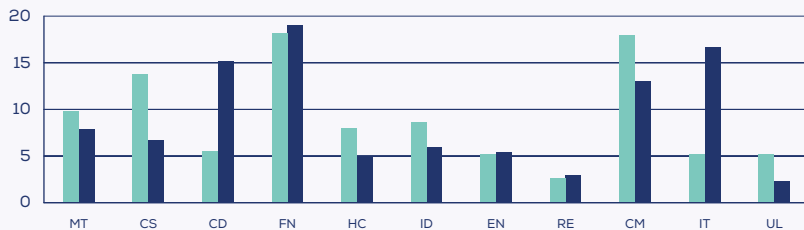
■ OssiEM Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)

■ SP/IFCI® Composite NR (USD)

AE: Émirats Arabes Unis • BR: Brésil • CN: Chine • HK: Hong Kong • IN: Inde • KR: Corée • MX: Mexique • MY: Malaisie • PE: Pérou • SA: Arabie Saoudite • TH: Thaïlande • TW: Taïwan

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

## ALLOCATION SECTORIELLE



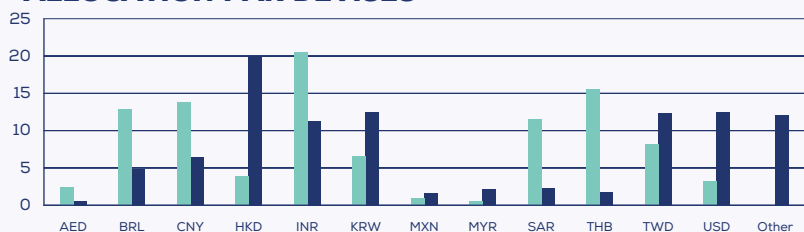
■ OssiEM Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)

■ SP/IFCI® Composite 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 OssiEM au 31.08.2020. Sources: OssiEM, Standard & Poor's

## ALLOCATION PAR DEVISES



■ OssiEM Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)

■ SP/IFCI® Composite NR (USD)

AED: Dirham émirati • BRL: Réal brésilien • CNY: Yuan Chinois • HKD: Hong Kong Dollar • INR: Roupie indienne • KRW: Won sud-coréen • MXN: Peso Mexicain • MYR: Ringgit Malaisien • SAR: Saudi Arabia Riyal • THB: Baht Thaïlandais • TWD: Nouveau Dollar Taïwanais • USD: Dollar américain

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

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

Titre	OssiEM Emerging Markets Minimum Variance Index NR	SP/IFCI® Composite NR
SEEGENE INC	3,47	0,06
SAUDI TELECOM CO	2,54	0,21
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	2,45	0,18
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,42	0,19
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVEL	2,19	0,02
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	2,14	0,07
SF HOLDING CO LTD	2,11	0,03
ALINMA BANK	2,02	0,05
OI SA	1,95	0,02
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	1,85	0,07

Données calculées par OssiEM au 31.08.2020. Sources: OssiEM, 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.

OssiEM 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 OssiEM 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. OssiEM, 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. OssiEM, 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.

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.

OSSIEM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR n'est en aucun cas financé, approuvé, vendu ou promu par Standard & Poor's Financial Services LLC (« S&P »), par ses filiales ou par ses concédants. S&P, ses filiales et ses concédants ne font aucune déclaration et n'émettent aucune garantie, qu'elle soit expresse ou implicite, vis-à-vis des détenteurs de parts de OSSIEM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR ou de toute autre personne quant au bien-fondé d'un investissement en général en valeurs mobilières ou en particulier dans OSSIEM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR ou quant à la capacité de l'indice OssiEM Emerging Markets Minimum Variance Index Net Return USD (l'« Indice ») à suivre les performances générales du marché des actions. S&P et ses concédants tiers n'entretiennent avec OssiEM qu'une relation d'octroi de licences pour certaines marques, marques de services et marques déposées par S&P et/ou ses concédants tiers et de prise en charge des calculs et des services de maintenance liés à l'Indice. S&P, ses filiales et ses concédants tiers ne peuvent être tenus pour responsables de, ni n'ont participé à la détermination des prix et du montant de OSSIEM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR, à la planification de l'émission ou de la vente de OSSIEM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR ou à la détermination ou au calcul de l'équation par laquelle OSSIEM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR est converti en liquidités. S&P n'a aucune obligation ni responsabilité quant à la gestion, à la mise sur le marché ou au négoce de OSSIEM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR.

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 OssiEM 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 OssiEM 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.