

Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)

Description de la stratégie

La stratégie Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector a pour objectif d'offrir un profil de risque/rendement similaire à celui de l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value, mais avec un profil ESG amélioré et une empreinte carbone significativement réduite.

La stratégie repose sur le même principe que l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value. Elle 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.

Un profil ESG amélioré : la stratégie exclut les sociétés impliquées dans les secteurs controversés de l'armement, du tabac, du charbon et autres controverses graves relatives à l'environnement, à la société et à la gouvernance.

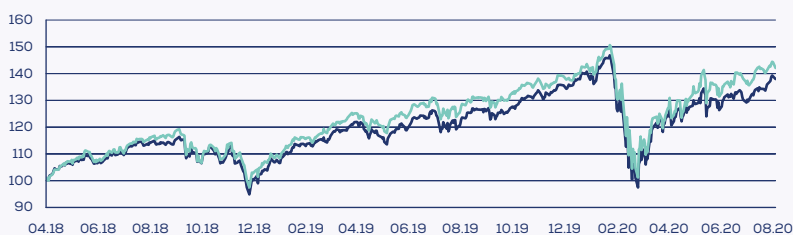
Une empreinte carbone réduite : la stratégie, comparée à son indice initial, vise une réduction de 40% des émissions totales de gaz à effet de serre (GES), des intensités de carbone (GES / revenus des entreprises) et des émissions potentielles de GES provenant des réserves de combustibles fossiles.

Principaux bénéficiaires de la Stratégie :

- 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
- Une stratégie qui combine un filtre ESG et des objectifs de réduction des émissions carbonées

PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)
S&P 500® Index NR (EUR)



Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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 | 4,77 | 3,00 | 10,44 | - | - | 15,98 |
| Univers d'investissement | 5,93 | 2,61 | 11,63 | 13,61 | 12,28 | 14,64 |

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

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

| | Volatilité annualisée % | Alpha % annualisé | Beta | Ratio de Sharpe | Perte max. % |
|--------------------------|-------------------------|-------------------|------|-----------------|--------------|
| Fonds | 25,35 | 1,28 | 1,00 | 0,65 | -32,83 |
| Univers d'investissement | 24,78 | - | - | 0,61 | -33,63 |

Données calculées par Ossiam au 31.08.2020. Sources: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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 d'investissement ESG, 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 (DIC). 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'UNIVERS D'INVESTISSEMENT

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| Nom | S&P 500® Index NR (EUR) |
| Ticker Bloomberg | SPTR500N Index |
| Date de lancement | 31.12.1998 |
| Classe d'actifs | Action |
| Fréquence de rebalancement | Mensuelle |

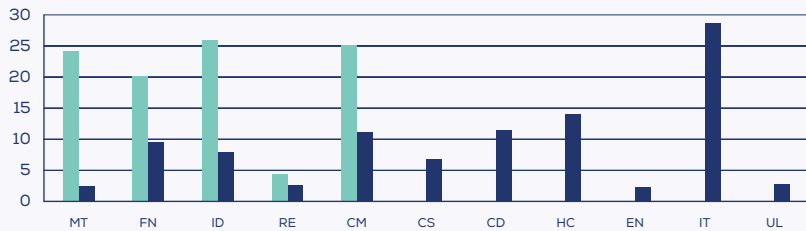
DONNÉES DU FONDS

| | |
|--------------------------------|--|
| Dépositaire | The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch |
| Structure juridique | Compartment de l'Ossiam IRL ICAV |
| UCITS | Oui |
| Catégorie | ETF géré activement |
| PEA | Non |
| Dividendes | Réinvestis |
| Encours total du fonds | USD 209 748 855 |
| Encours de la classe d'actions | EUR 86 125 429 |
| Valeur liquidative | EUR 74,110 |
| Nombre de parts | 1 162 131 |
| Devise du fonds | USD |
| Devise de la classe d'actions | EUR |
| ISIN | IE00BF92LV92 |
| Date de lancement | 05.04.2018 |
| Méthode de réplication | Physique |
| TER (Frais/an) | 0,75% |

INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

| | |
|---|---|
| Heure limite de réception des ordres (marché primaire ¹) | 15h00 (heure irlandaise) le Jour de négociation |
| Investissement minimum (marché secondaire) | 1 Action |
| ¹ Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités | |
| XETRA en EUR | SHEE GY |
| Borsa Italiana en EUR | SHEE IM |

ALLOCATION SECTORIELLE



■ Ossia ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)

■ S&P 500® Index NR (EUR)

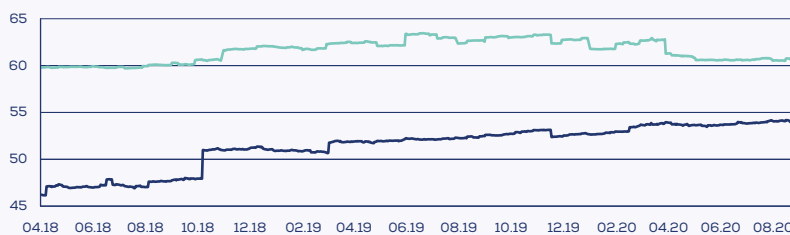
MT: Matériaux • CS: Biens de consommation de base • CD: Biens de consommation durables • FN: Sociétés Financières • HC: Santé • ID: Industries • EN: Énergie • RE: Immobilier • CM: Services de communication • IT: Technologies de l'information • UL: Services aux Collectivités

Données calculées par Ossia au 31.08.2020. Sources: Ossia, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

SCORES ESG*

— Ossia ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)

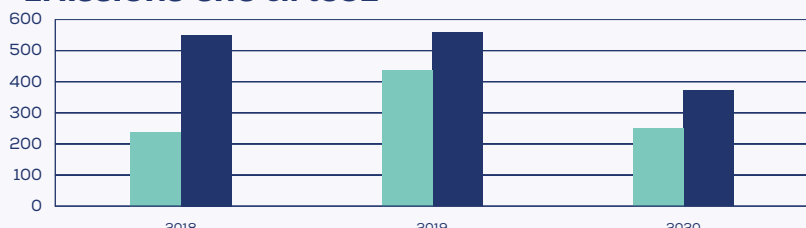
— S&P 500® Index NR (EUR)



Données calculées par Ossia au 31.08.2020. Sources: Ossia, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

*Le score ESG est une moyenne pondérée des scores ESG de chaque composant de l'indice.

EMISSIONS GHG en tCO2**



■ Ossia ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)

■ S&P 500® Index NR (EUR)

Données calculées par Ossia au 31.08.2020. Sources: Ossia, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

**Les émissions de gaz à effet de serre sont en tonnes équivalent de CO2 pour 1 million de USD investis dans l'indice

TOP 10 DES VALEURS CONSTITUTIVES DU FONDS (%)

| | Ossia ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF | S&P 500® Index NR |
|------------------------------|---|-------------------|
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 4,38 | 0,85 |
| LINDE PLC | 4,36 | 0,45 |
| NETFLIX INC | 4,03 | 0,80 |
| WALT DISNEY CO/THE | 3,41 | 0,82 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 2,89 | 0,19 |
| AMETEK INC | 2,76 | 0,08 |
| ECOLAB INC | 2,71 | 0,17 |
| NEWMONT MINING CORP | 2,67 | 0,19 |
| TWITTER INC | 2,31 | 0,11 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 2,15 | 0,22 |

Données calculées par Ossia au 31.08.2020. Sources: Ossia, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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.

Ossia IRL ICAV (l'« ICAV ») est un fonds à compartiments multiples constitué en tant que société d'investissement à capital variable de droit irlandais avec une responsabilité distincte entre les compartiments et autorisé par la Banque centrale d'Irlande sous le numéro C173953. L'ICAV a nommé Ossia sa société de gestion, responsable de la gestion financière des fonds, l'administration et la distribution de l'ICAV. Ossia, 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. Ossia, 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'exactitude, l'exhaustivité ou la pertinence des informations provenant de sources externes ne sont pas garanties bien qu'elles aient été établies à partir de sources sérieuses, réputées fiables.

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 Ossia 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 Ossia n'a pas reçu d'autorisation de commercialisation.

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.