

Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF 1A (EUR)

Description de la stratégie

Le fonds Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF a pour objectif de répliquer la performance de l'indice US ESG Minimum Variance Index NR calculé et publié par Solactive AG.

La stratégie vise à réduire la volatilité de l'univers d'investissement tout en maintenant un niveau élevé de diversification. Elle utilise les estimations de volatilité des actions ainsi que leurs corrélations afin de construire un portefeuille « long only » défensif.

Le processus d'optimisation est appliqué à un univers d'actions filtré selon des critères ESG (70% des actions les mieux notées en accord avec les critères ESG sont conservés pour chaque sous-secteur ; les actions sujettes à controverse sont exclues; la sélection repose sur une échelle d'évaluation mise en place par Sustainalytics).

Cette approche est adaptée aux investisseurs recherchant une exposition sur le long terme avec une volatilité moins importante que celle du marché et tenant compte des critères ESG.

- Exposition au marché des actions américaines avec une approche ESG
- Objectif de réduction de la volatilité
- Bénéfice de l'anomalie de faible volatilité

PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

— Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF 1A (EUR)
— Solactive US Large Cap Net TR Index* (EUR)



Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics

PERFORMANCES NETTES

	Perf. 1 mois %	Perf. depuis Jan. %	Perf. 1 an %	Perf. 3-ans annualisée %	Perf. 5-ans annualisée %	Annualisée depuis la création %
Fonds	-1,81	-5,36	-4,64	6,94	7,04	12,43
Indice	-1,79	-4,83	-3,98	7,77	7,62	12,84
Univers d'investissement	-2,04	0,42	5,81	10,48	10,28	14,97

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité annualisée %	Alpha % annualisé	Beta	Tracking Error 1 an %	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	15,22	1,25	0,75	0,13	0,82	-30,43
Indice	15,23	1,66	0,75	-	0,85	-30,34
Univers d'investissement	18,87	-	-	-	0,80	-33,65

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics

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 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.

*L'indice de référence (ainsi que son Benchmark) est calculé en utilisant la performance de l'Indice Ossiam US Minimum Variance NR (resp. S & P 500 Index NR) jusqu'au 16 juin 2017 et la performance de l'US ESG Minimum Variance NR Index (resp. NR Solactive US Large CAP Index) par la suite. Cela reflète le changement de référence qui est entré en vigueur sur le fonds le 16 juin 2017.

Le fonds Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF, un compartiment d'Ossiam IRL ICAV, a été créé le 24 avril 2020 suite à la fusion-absorption du fonds Ossiam US Minimum Variance ESG NR, un compartiment de la SICAV Ossiam Lux, avec un ratio de 1 pour 1. Les données présentées sur le fonds avant le 24 avril 2020 sont celles du compartiment luxembourgeois et sont affichées à titre d'information.

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

RISQUE PLUS FAIBLE RISQUE PLUS ÉLEVÉ



RENDEMENTS GÉNÉRALEMENT PLUS FAIBLES RENDEMENTS GÉNÉRALEMENT PLUS ÉLEVÉS

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	US ESG Minimum Variance Index NR* (USD)
Univers d'investissement	Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)
Ticker Bloomberg	ESGUSMVN
Date de lancement	09.03.2016
Classe d'actifs	Action
Fréquence de rebalancement	Mensuelle

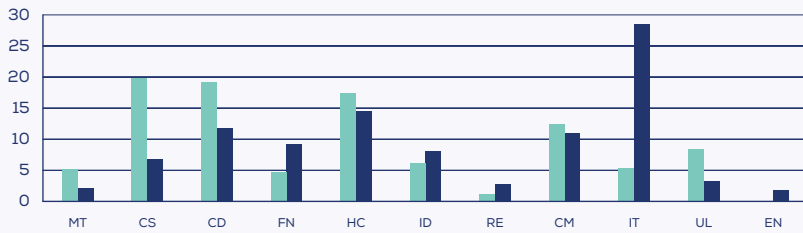
DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Structure juridique	Compartiment d'Ossiam IRL ICAV
UCITS	Oui
PEA	Non
Dividendes	Reinvestis
Encours total du fonds	USD 201 479 070
Encours de la classe d'actions	EUR 118 332 260
Valeur liquidative	EUR 201,358
Nombre de parts	587 671
Devise du fonds	USD
Devise de la classe d'actions	EUR
ISIN	IE00BHNGHX58
Date de lancement	24.04.2020
Méthode de répllication	Physique
TER (Frais/an)	0,65%

INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire ¹)	15h00 (heure irlandaise)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action
¹ Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités	
XETRA en EUR	OSX2 GY
Euronext Paris en EUR	SPMV FP
SIX Swiss Exchange en EUR	SPMV SW
Borsa Italiana en EUR	SPMV IM

ALLOCATION SECTORIELLE



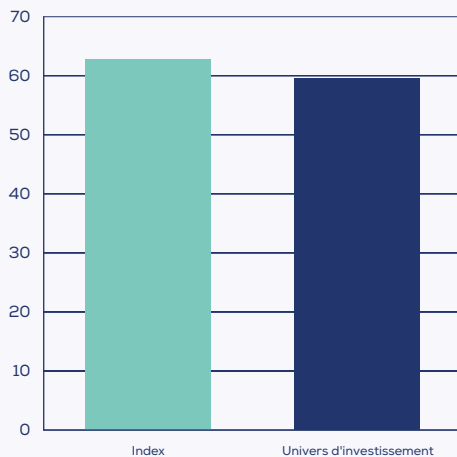
■ US ESG Minimum Variance Index NR* (USD)

■ Solactive US Large Cap Net TR Index* (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 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics

NOTATION ESG MOYENNE



■ US ESG Minimum Variance Index NR* (USD)

■ Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics

TOP 10 DES VALEURS CONSTITUTIVES DU FONDS (%)

	US ESG Minimum Variance Index NR*	Solactive US Large Cap Net TR Index*	Notation ESG
TIFFANY & CO	5,05	0,06	57,34
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,65	0,86	76,54
NEWMONT MINING CORP	3,83	0,18	77,99
KROGER CO	3,58	0,09	68,20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,20	0,48	67,49
ABBVIE INC	2,70	0,54	67,97
AUTOZONE INC	2,50	0,10	51,87
ELECTRONIC ARTS INC	2,45	0,12	58,44
CLOROX COMPANY	2,38	0,09	68,34
MCDONALD'S CORP	2,21	0,57	59,77

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics

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 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 Ossiam sa société de gestion, responsable de la gestion financière des fonds, l'administration et la distribution de l'ICAV. 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'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.

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.

L'instrument financier n'est pas sponsorisé, promu, vendu ou soutenu de quelque autre manière que ce soit par Solactive AG et Solactive AG n'offre aucune garantie ou assurance expresse ou implicite que ce soit en ce qui concerne les résultats de l'utilisation de l'Indice et/ou de la marque de l'Indice ou du Prix de l'Indice, ce à tout moment ou à tout autre titre. L'Indice est calculé et publié par Solactive AG, laquelle met tout en oeuvre pour garantir l'exactitude du calcul de l'Indice. Indépendamment de ses obligations envers l'Émetteur, Solactive AG n'est pas tenue de signaler les erreurs dans l'Indice à des tiers, y compris, mais sans s'y limiter, aux investisseurs et/ou aux intermédiaires financiers de l'instrument financier. La publication de l'Indice par Solactive AG et l'octroi de licence de l'Indice ou de la marque d'Indice à des fins d'utilisation dans le cadre de l'instrument financier ne constituent en aucune manière une recommandation de Solactive AG d'investir dans ledit instrument financier ni ne représentent une assurance ou l'opinion de Solactive AG concernant tout investissement dans ledit instrument financier.

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.

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.