

OSSIAM STOXX® Europe 600 Equal Weight NR UCITS ETF 1C (EUR)

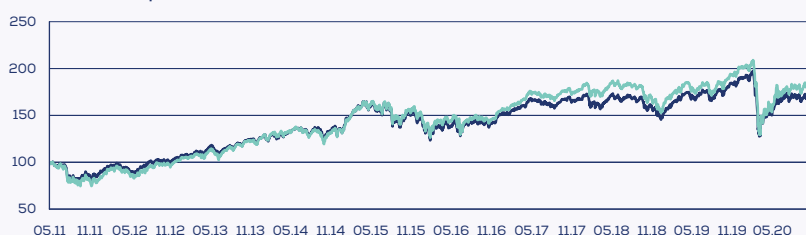
Description de la stratégie

La stratégie Equal Weight vise à éviter les biais « large cap » et de « trend following » des indices pondérés par la capitalisation boursière, en attribuant le même poids à tous les constituants de l'indice à chacune des dates de rebalancement. L'indice équipondéré vise à offrir aux investisseurs une exposition diversifiée à l'indice STOXX® Europe 600, tout en évitant la prépondérance des capitalisations les plus importantes.

- Une stratégie permettant d'éviter les biais de concentration et de « trend following »
- Une exposition diversifiée à l'indice STOXX® Europe 600
- Une exposition plus équilibrée petites et moyennes capitalisations en comparaison aux indices pondérés par la capitalisation boursière

PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

— OSSIAM STOXX® Europe 600 Equal Weight NR UCITS ETF 1C (EUR)
 — STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)



Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

PERFORMANCES NETTES

| | Perf. 1 mois % | Perf. depuis Jan. % | Perf. 1 an % | Perf. 3-ans annualisée % | Perf. 5-ans annualisée % | Annualisée depuis la création % |
|--------------------------|----------------|---------------------|--------------|--------------------------|--------------------------|---------------------------------|
| Fonds | -4,17 | -15,17 | -10,30 | -1,53 | 1,91 | 5,77 |
| Indice | -4,17 | -15,19 | -10,29 | -1,52 | 1,92 | 5,83 |
| Univers d'investissement | -5,11 | -16,07 | -12,28 | -2,02 | 0,85 | 5,00 |

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

| | Volatilité annualisée % | Alpha % annualisé | Beta | Tracking Error 1 an % | Ratio de Sharpe | Perte max. % |
|--------------------------|-------------------------|-------------------|------|-----------------------|-----------------|--------------|
| Fonds | 18,01 | 0,65 | 1,02 | 0,05 | 0,33 | -38,12 |
| Indice | 18,01 | 0,72 | 1,02 | — | 0,33 | -38,15 |
| Univers d'investissement | 17,28 | — | — | — | 0,29 | -35,36 |

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

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 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 | STOXX® Europe 600 Equal Weight Index NR (EUR) |
| Univers d'investissement | STOXX® Europe 600 Index NR (EUR) |
| Ticker Bloomberg | SXXEWR Index |
| Date de lancement | 28.10.2010 |
| Classe d'actifs | Action |
| Fréquence de rebalancement | Trimestrielle |

DONNÉES DU FONDS

| | |
|--------------------------------|---|
| Dépositaire | State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch |
| Structure juridique | Compartment d'Ossiam Lux SICAV |
| UCITS | Oui |
| PEA | Oui |
| Dividendes | Réinvestis |
| Encours total du fonds | EUR 195 510 448 |
| Encours de la classe d'actions | EUR 195 510 448 |
| Valeur liquidative | EUR 85,862 |
| Nombre de parts | 2 277 040 |
| Devise du fonds | EUR |
| Devise de la classe d'actions | EUR |
| ISIN | LU0599613147 |
| Date de lancement | 16.05.2011 |
| Méthode de réplcation | Synthétique |
| TER (Frais/an) | 0,35% |

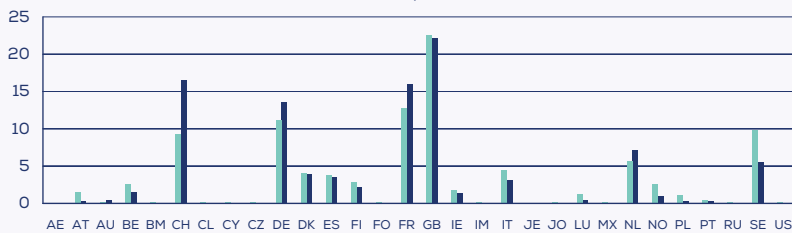
INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

| | |
|--|-----------------------------|
| Heure limite de réception des ordres (marché primaire ¹) | 15h30 (heure de Luxembourg) |
| Investissement minimum (marché secondaire) | 1 Action |

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

| | |
|------------------------------|---------|
| London Stock Exchange en EUR | S6EW LN |
| London Stock Exchange en GBP | L6EW LN |
| XETRA en EUR | OSX6 GY |
| Euronext Paris en EUR | S6EW FP |
| SIX Swiss Exchange en EUR | S6EW SW |
| Borsa Italiana en EUR | S6EW IM |

ALLOCATION GÉOGRAPHIQUE



■ STOXX@ Europe 600 Equal Weight Index NR (EUR)

■ STOXX@ Europe 600 Index NR (EUR)

AE: Émirats Arabes Unis • AT: Autriche • AU: Australie • BE: Belgique • BM: Bermudes • CH: Suisse • CL: Chili • CY: Cyprus • CZ: Czech Republic • DE: Allemagne • DK: Danemark • ES: Espagne • FI: Finlande • FO: Faroe Islands • FR: France • GB: Royaume-Uni • IE: Irlande • IM: Île de Man • IT: Italie • JE: Jersey • JO: Jordanie • LU: Luxembourg (pays) • MX: Mexique • NL: Pays-Bas • NO: Norvège • PL: Pologne • PT: Portugal • RU: Fédération de Russie • SE: Suède • US: Etats-Unis

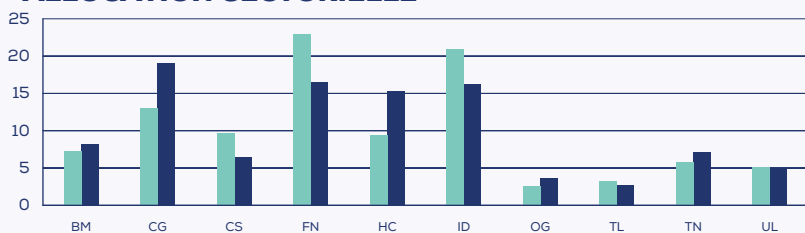
Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

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

| | STOXX@ Europe 600 Equal Weight Index NR | STOXX@ Europe 600 Index NR |
|----------------------------|---|----------------------------|
| G4S PLC | 0,26 | 0,05 |
| DIPLOMA PLC | 0,23 | 0,04 |
| ALTICE NV | 0,23 | 0,04 |
| DIASORIN SPA | 0,22 | 0,07 |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 0,22 | 0,17 |
| NATWEST GROUP PLC | 0,22 | 0,09 |
| AMS AG | 0,21 | 0,06 |
| HOWDEN JOINERY GROUP PLC | 0,21 | 0,06 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 0,21 | 0,31 |
| EDF | 0,21 | 0,07 |

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

ALLOCATION SECTORIELLE



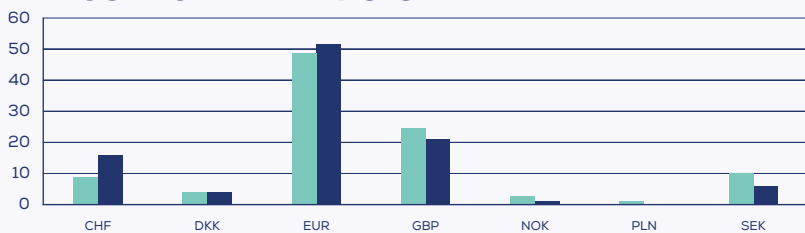
■ STOXX@ Europe 600 Equal Weight Index NR (EUR)

■ STOXX@ Europe 600 Index NR (EUR)

BM: Matériaux de Base • CG: Biens de Consommation • CS: Services aux Consommateurs • FN: Sociétés Financières • HC: Santé • ID: Industries • OG: Pétrole et Gaz • TL: Télécommunications • TN: Technologie • UL: Services aux Collectivités

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

ALLOCATION PAR DEVISES



■ STOXX@ Europe 600 Equal Weight Index NR (EUR)

■ STOXX@ Europe 600 Index NR (EUR)

CHF: Franc Suisse • DKK: Couronne danoise • EUR: Euro • GBP: Livre Sterling • NOK: Couronne Norvégienne • PLN: Zloty Polonais • SEK: Couronne Suédoise

Données calculées par Ossiam au 30.10.2020. Sources: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

CONTACT / INFO

www.ossiam.com
 mail : info@ossiam.com
 TEL +33 1 84 79 42 70
 87 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 numéro de la Commission de Surveillance du Secteur Financier du grand-duché de 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.

Le fonds OSSIAM STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 17/06/2011. Pour les investisseurs basés en Suisse, le fonds OSSIAM STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en Suisse depuis le 16/05/2011. 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. STOXX et ses concédants déclinent toute responsabilité relative au STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR. Plus précisément, STOXX et ses concédants ne fournissent ni n'assurent aucune garantie, expresse ou implicite, que ce soit concernant : Les résultats devant être obtenus par le STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR, le détenteur de parts du STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR ou toute personne impliquée dans l'utilisation de l'indice STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index NR et des données incluses dans cet indice ; L'exactitude ou l'exhaustivité de l'indice STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index NR et des données qu'il contient ; La négociabilité de l'indice STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index NR et de ses données ainsi que leur adéquation à un usage précis ou à une fin particulière ; STOXX et ses concédants ne peuvent être tenus pour responsables de quelque erreur, omission ou interruption que ce soit dans l'indice STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT Index NR ou les données qu'il contient ; En aucun cas, STOXX ou ses Concédants ne sauraient en aucun cas être tenus pour responsables de tout manque à gagner ou de dommages ou pertes indirects, punitifs ou particuliers, même si STOXX et ses concédants savent que ces risques existent. Le contrat de licence entre (détenteur de licence) et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des détenteurs de parts de la STOXX@ EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR ou de tiers. 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. 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.