

OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE L'ETF

Le Fonds OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR a pour objectif de répliquer l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice de stratégie Ossiam World Minimum Variance Index Net Return USD, nette des frais supportés par le fonds (TER).

DESCRIPTION DE L'INDICE

L'Indice de stratégie Ossiam World Minimum Variance NR reflète l'évolution (dividendes nets réinvestis) d'un portefeuille de titres constitué d'un échantillon dynamique des titres les plus liquides parmi les grandes capitalisations de l'indice S&P Global 1200® (univers d'investissement), pondéré de façon à minimiser la volatilité du portefeuille (pondération optimale).

STRATÉGIE MINIMUM VARIANCE

La stratégie Minimum Variance initiée par Ossiam vise à offrir aux investisseurs une exposition à un portefeuille diversifié avec une volonté de réduction de la volatilité à long terme. La stratégie a pour objectif d'aboutir à un portefeuille optimisé qui inclut une sélection d'actions dont les volatilités sont parmi les plus basses de l'univers d'investissement et dont les corrélations historiques sont suffisamment modérées pour permettre une réduction significative de la volatilité, sans pour autant aboutir à un portefeuille restreint tant en nombre de titres qu'en terme de diversification sectorielle.

CARACTÉRISTIQUES DE L'ETF

Places de cotation	Euronext Paris, Xetra, Borsa Italiana, SIX Swiss Exchange
AUM Classe d'action	22 765 204,30 (EUR)
AUM Total Fonds	32 993 708,44 (USD)
NAV	141,244 (EUR)
Nombre d'actions	161 176,00
Fréquence de rebalancement	Semestrielle
Mode de réplcation	Physique
SRD	Oui
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
TER annuel	0,65%
Investissement minimum	1 action
Classe d'action	1C
ISIN	LU0799656698

Structure juridique	SICAV luxembourgeoise
Date de lancement	04/09/2012
Fréquence calcul NAV	Quotidienne
Dépositaire	State Street Bank Luxembourg S.A.
Devise	EUR
Cut-off	16.00 (-1)

	Reuters	Bloomberg
iNAV	.IWOMV	IWOMV
Euronext Paris	WOMV.PA	WOMV.FP

Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

TOP 10 DES VALEURS (31/08/2017)

OSSIAM World Minimum Variance Index NR (EUR)

INTUITIVE SURGICAL INC	2,69%
CONSOLIDATED EDISON INC	2,47%
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,22%
WAL-MART STORES INC	2,11%
CME GROUP INC	2,08%
SOUTHERN CO/THE	2,07%
LOCKHEED MARTIN CORP	2,03%
Dominion Energy Inc	1,95%
MCDONALD'S CORP	1,87%
ASTELLAS PHARMA INC	1,83%

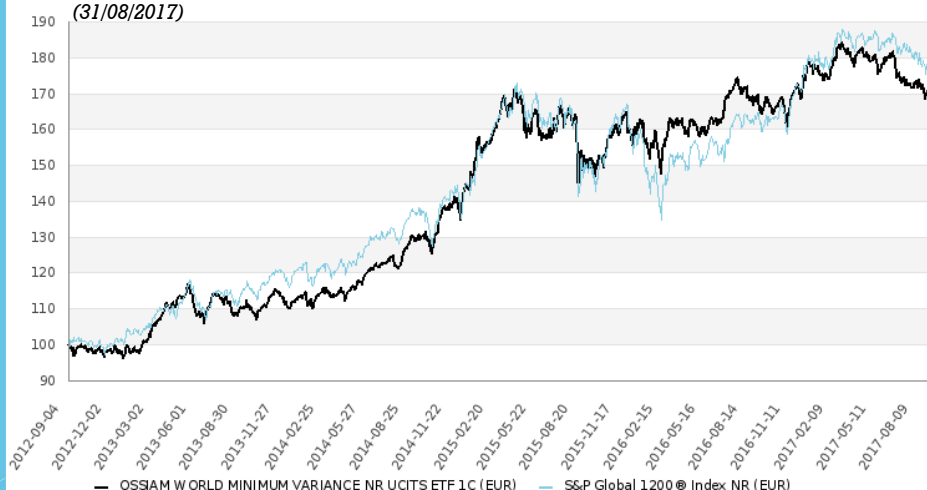
Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

S&P Global 1200® Index NR (EUR)

APPLE INC	2,30%
MICROSOFT CORP	1,55%
FACEBOOK INC-A	1,09%
AMAZON.COM INC	1,05%
JOHNSON & JOHNSON	0,96%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0,93%
EXXON MOBIL CORP	0,87%
JPMorgan Chase & Co	0,87%
ALPHABET INC-CL A	0,76%
ALPHABET INC-CL C	0,75%

Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

Performance de l'ETF depuis le lancement** (31/08/2017)



Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

PERFORMANCES (%) ** (31/08/2017)

	OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR UCITS ETF 1C (EUR)	OSSIAM World Minimum Variance Index NR (EUR)	S&P Global 1200® Index NR (EUR)
YTD	-2,50	-2,13	1,35
1 an	1,51	2,03	9,51
3 ans annualisés	10,11	10,53	9,76
5 ans annualisés	*	11,84	12,35
Depuis le lancement	70,92	74,79	79,07

Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

INDICATEURS DE RISQUE DEPUIS LE LANCEMENT** (31/08/2017)

	OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR UCITS ETF 1C (EUR)	OSSIAM World Minimum Variance Index NR (EUR)	S&P Global 1200® Index NR (EUR)
Volatilité annualisée (%)	11,80	11,81	13,49
Corrélation vs univers	0,89	0,89	-
Drawdown maximum (%)	-15,36	-15,26	-22,06
Alpha	0,02	0,02	-
Bêta	0,78	0,78	-
Ratio de Sharpe	0,97	1,01	0,92
Tracking Error (%)	0,06	0,00	-

Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

* Il existe trop peu de données pour fournir aux investisseurs de ce Fonds des indications utiles sur les performances passées.

** Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

Cette classe en EUR n'est pas hedgée contre le risque de change.

REPARTITION SMALL MID LARGE CAP (31/08/2017)

	OSSIAM World Minimum Variance Index NR (EUR)	S&P Global 1200® Index NR (EUR)
Small	0	0,21
Mid	0	0,16
Large	100,00	99,63

Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

PARTICIPANTS AUTORISÉS :

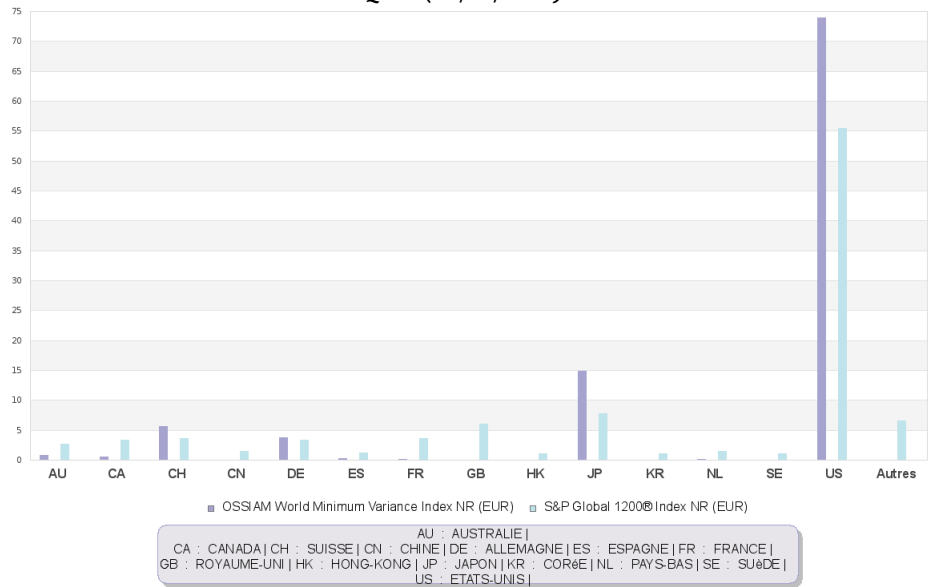
Baader Bank AG	+49 69 13881 333
Banca IMI	+39 027 261 5318
BOAML	+44 207 996 1034
Barclays	+44 203 134 8021
BNP Paribas	+44 207 595 8998
Commerzbank	+49 69 136 22 088
Crédit Suisse	+44 207 888 6549
Deutsche Bank	+44 207 547 5147
Flow Traders	+31 20 799 6777
Intermonte	+39 02 7711 5203
Jane Street	+44 20 3100 3400
JP Morgan	+44 20 7779 3129
Morgan Stanley	+44 207 677 8652
Natixis	+33 1 58 55 84 11
Société Générale	+33 1 42 13 56 10
Susquehanna	+353 1802 8018
UBS	+44 207 567 9292
Unicredit	+44 207 826 6789

MANAGEMENT :

Société de gestion	Ossiam
--------------------	--------

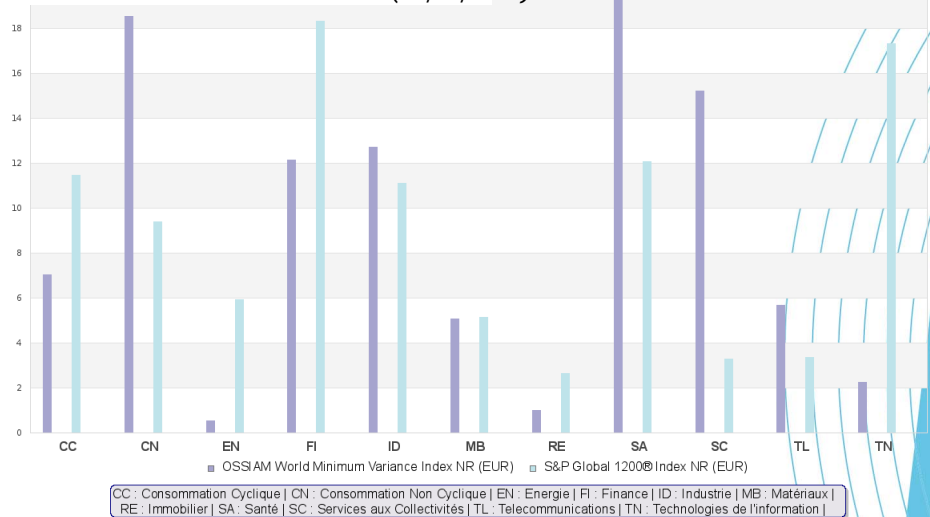
Contact :
www.ossiam.com
80 avenue de la Grande Armée
75017 Paris - France
Tel: + 33 1 84 79 42 70

RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE (31/08/2017)



Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam
Allocation basée sur le champs Bloomberg "Country of Incorporation"

RÉPARTITION SECTORIELLE (31/08/2017)



Source : Bloomberg/Standard & Poor's, calculs effectués par Ossiam

AVERTISSEMENT

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 2011/74085-7020-0-PC de la Commission de Surveillance du Secteur Financier du grand-duché du Luxembourg le 22 avril 2011. Le fonds OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 24/09/2012. À compter du 20 mai 2016, 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 Luxembourg 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 NGAM S.A., est agréée par l'Autorité des Marchés Financiers en qualité de Société de Gestion de Portefeuille sous le numéro GP-10000016. 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. Les éléments du présent document sont fournis sur la base des données de marché constatées à un moment précis et qui sont susceptibles de varier. Les risques inhérents au fonds et à l'indice de stratégie sont détaillés dans la section « Facteurs de Risque » du prospectus disponible en français sur le site internet www.ossiam.fr. Il est important d'en prendre connaissance avant d'investir. Il est également nécessaire de bien s'informer sur les principales caractéristiques de l'indice sous-jacent (nombre et principales valeurs, allocation sectorielle et ou géographique, évolutions passées...) afin d'avoir une vision d'ensemble des opportunités et des risques liés à une exposition sur cet indice de stratégie. OSSIAM World Minimum Variance NR USD ("l'indice de stratégie") est la propriété exclusive d'Ossiam. L'indice de stratégie est calculé par Standard & Poor's Financial Services LLC dans le cadre d'un contrat de licence. Standard & Poor's® et S&P® sont des marques déposées par Standard & Poor's Financial Services LLC. S&P et ses filiales ne peuvent être tenus responsables de toute erreur ou omission dans le calcul de l'Indice. OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR (EUR) n'est ni parrainé, ni approuvé, ni vendu ou préconisé par S&P et ses filiales. S&P et ses filiales ne font aucune recommandation quant à un investissement dans le compartiment OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR.