

Ossiam World Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

La stratégie Minimum Variance vise à réduire la volatilité de l'univers d'investissement tout en maintenant un niveau élevé de diversification.

La stratégie prend en compte les estimations de volatilité des actions ainsi que leur corrélation afin de construire un portefeuille « long only » défensif.

Cette approche est adaptée aux investisseurs recherchant une exposition de long terme avec une volatilité réduite par rapport à celle du marché.

- Exposition au marché actions
- Objectif de réduction de la volatilité
- Bénéficie de l'anomalie de faible volatilité

PERFORMANCE DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT

29.12.2017

— Ossiam World Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)
— S&P Global 1200® Index NR (EUR)



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

PERFORMANCES

29.12.2017

| Date | MTD PERF % | YTD PERF % | Perf. 1-an % | Perf. 3-ans annualisées % | Perf. 5-ans annualisées % | Annualisée depuis la création % |
|----------------------------------|---------------|---------------|-----------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------------|
| Fonds | -1,47 | 3,59 | 2,78 | 7,86 | 13,59 | 11,87 |
| Indice | -1,42 | 4,23 | 3,43 | 8,32 | 14,10 | 12,39 |
| Univers d'investis- sement | 0,73 | 8,17 | 7,36 | 9,60 | 13,85 | 12,94 |

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

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

29.12.2017

| Datum | Volatilité annualisée % | Alpha % annualisé | BETA | Tracking Error 1-an % | Ratio de Sharpe | Perte max. % |
|----------------------------------|----------------------------|----------------------|------|--------------------------|--------------------|--------------|
| Fonds | 11,61 | 1,76 | 0,78 | 0,09 | 1,02 | -15,36 |
| Index | 11,62 | 2,28 | 0,78 | - | 1,07 | -15,26 |
| Univers d'investis- sement | 13,23 | - | - | - | 0,98 | -22,06 |

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

Informations importantes : 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 marchés 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 peut être sujet à divers risques (risque indicel, risque lié aux instruments dérivés et aux contreparties, risque de concentration géographique). Veuillez lire la section du prospectus intitulée "Risques généraux" pour de plus amples renseignements sur les risques.

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

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'INDICE

| | |
|----------------------------|--|
| Nom | Ossiam World Minimum Variance Index NR (USD) |
| Univers d'investissement | S&P Global 1200® Index NR (USD) |
| Ticker Bloomberg | OWMVNR Index |
| Date de lancement | 16.07.2012 |
| Classe d'actifs | Action |
| Fréquence de rebalancement | Semestrielle |

DONNÉES DU FONDS

| | |
|--------------------------------|----------------------------------|
| Dépositaire | State Street Bank Luxembourg S.A |
| Structure juridique | SICAV Luxembourgeoise |
| UCITS | Oui |
| PEA | Non |
| Dividendes | Réinvestis |
| Encours total du fonds | USD 32 703 179 |
| Encours de la classe d'actions | EUR 24 187 849 |
| Valeur liquidative | EUR 150,071 |
| Nombre de parts | 161 176 |
| Devise du fonds | USD |
| Devise de la classe d'actions | EUR |
| ISIN | LU0799656698 |
| Date de lancement | 04.09.2012 |
| Méthode de réplcation | Physique |
| TER (Frais/an) | 0,65% |

INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

| | |
|--|-------------------------------|
| Heure limite de réception des ordres (marché primaire) | 16h heure du Luxembourg (J-1) |
| Investissement minimum (marché secondaire) | 1 Action |

Ticker sur Euronext Paris

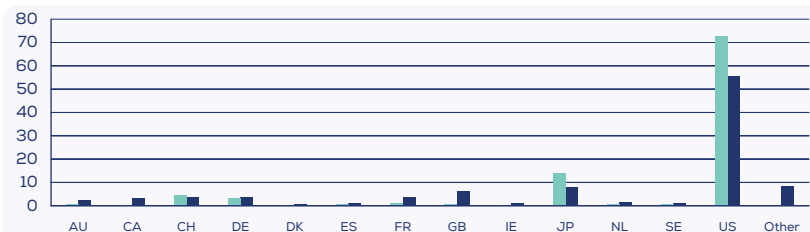
Ticker Bloomberg WOMV FP

TOP 10 DES VALEURS (%)

29.12.2017

| | Ossiam World Minimum Variance Index NR | S&P Global 1200® Index NR |
|----------------------------|--|---------------------------|
| FANUC CORP | 2,58 | 0,12 |
| WAL-MART STORES INC | 2,42 | 0,36 |
| RAYTHEON COMPANY | 2,20 | 0,14 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 2,18 | 0,08 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 2,15 | 0,20 |
| FAST RETAILING CO LTD | 1,98 | 0,06 |
| ASTELLAS PHARMA INC | 1,95 | 0,07 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 1,95 | 0,09 |
| CME GROUP INC | 1,93 | 0,12 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,88 | 0,34 |

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



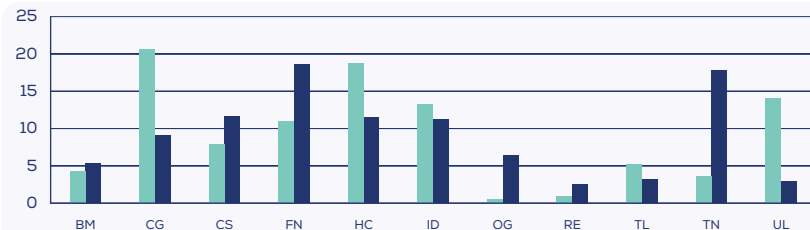
ALLOCATION GÉOGRAPHIQUE (29.12.2017)

■ Ossiam World Minimum Variance Index NR (USD)

■ S&P Global 1200® Index NR (USD)

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

AU: Australia • CA: Canada • CH: Switzerland • DE: Germany • DK: Denmark • ES: Spain • FR: France • GB: United Kingdom • IE: Ireland • JP: Japan • NL: Netherlands • SE: Sweden • US: United States



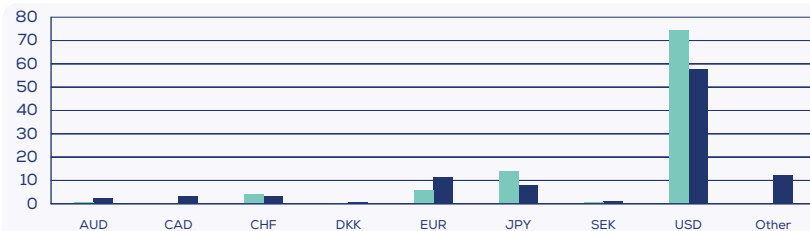
ALLOCATION SECTORIELLE (29.12.2017)

■ Ossiam World Minimum Variance Index NR (USD)

■ S&P Global 1200® Index NR (USD)

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

BM: Materials • CG: Consumer Staples • CS: Consumer Discretionary • FN: Financials • HC: Health Care • ID: Industrials • OG: Energy • RE: Real Estate • TL: Telecommunications services • TN: Information Technology • UL: Utilities



ALLOCATION PAR DEVICES (29.12.2017)

■ Ossiam World Minimum Variance Index NR (USD)

■ S&P Global 1200® Index NR (USD)

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

AUD: Australian Dollar • CAD: Canadian Dollar • CHF: Swiss Franc • DKK: Danish krone • EUR: Euro • JPY: Japanese Yen • SEK: Swedish Krona • USD: US Dollar

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 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 de Luxembourg le 22 avril 2011. 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 Natixis Investment Managers (anciennement Natixis Global Asset Management), est agréée par l'Autorité des Marchés Financiers en qualité de Société de Gestion de Portefeuille sous le numéro GP-10000016.

Le fonds OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 24/09/2012.

OSSIAM WORLD 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 OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR ou de toute autre personne quant au bien-fondé d'un investissement en général en valeurs mobilières ou en particulier dans l' OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR ou quant à la capacité de l'indice Ossiam World 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 Ossiam 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 l' OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR, à la planification de l'émission ou de la vente de OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR ou à la détermination ou au calcul de l'équation par laquelle l' OSSIAM WORLD 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 l' OSSIAM WORLD MINIMUM VARIANCE NR.

S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE GARANTISSENT EN AUCUN CAS LA PERTINENCE, L'EXACTITUDE, LA VALIDITÉ OU L'EXHAUSTIVITÉ NI DE L'INDICE, NI DES DONNÉES QUI LE COMPOSENT, NI DES COMMUNICATIONS, DONT ENTRE AUTRES, LES COMMUNICATIONS VERBALES ET ÉCRITES (Y COMPRIS LES COMMUNICATIONS ÉLECTRONIQUES) QUI S'Y RAPPORTENT. S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE PEUVENT ÊTRE TENUS POUR RESPONSABLES DES DOMMAGES OU PERTES SURVENUS SUITE À DES ERREURS, OMISSIONS OU RETARDS LIÉS À L'INDICE, AUX DONNÉES ET AUX COMMUNICATIONS SUSMENTIONNÉS. S&P NE FORMULE AUCUNE GARANTIE, QU'ELLE SOIT EXPRESSE OU IMPLICITE, ET DÉNIE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE QUANT À LA QUALITÉ MARCHANDE OU À LA PERTINENCE POUR UN BUT OU UN USAGE PRÉCIS DE SES MARQUES COMMERCIALES, DE L'INDICE OU DE TOUTE DONNÉE QUI LE COMPOSE, SANS LIMITATION DE CE QUI PRÉCÈDE, S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE PEUVENT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUS POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE DOMMAGE INDIRECT, SPÉCIAL, MINEUR, PUNITIF OU IMPORTANT, DONT, SANS S'Y LIMITER, LES MANQUES À GAGNER, PERTES D'EXPLOITATION, PERTES DE TEMPS OU DÉGRADATIONS D'ACTIFS INCORPORÉLS, MÊME DANS LES CAS OÙ ILS ONT ÉTÉ INFORMÉS DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES, QUE CE SOIT EN VERTU D'UNE RESPONSABILITÉ CONTRACTUELLE, DÉLICTUELLE, CIVILE OU AUTRE. Standard & Poor's® ET S&P® sont des marques déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC. « Calculated by S&P Custom Indices » et sa marque stylisée connexe sont des marques de service de Standard & Poor's Financial Services LLC pour lesquelles Ossiam a obtenu une licence d'utilisation.

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.

