

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de ce fonds. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce fonds et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

OSSIAM US MINIMUM VARIANCE ESG NR (UCITS ETF 1C(USD) ISIN: LU0599612412), un compartiment de la SICAV OSSIAM LUX

Société de gestion : Ossiam, société du groupe Natixis

Objectifs et politique d'investissement

Objectif d'investissement

Le fonds OSSIAM US MINIMUM VARIANCE NR (ci-après «le Fonds») vise à répliquer, hors frais et dépenses, la performance de l'indice US ESG Minimum Variance NR, mesurée par son cours de clôture.

L'indice US Minimum Variance NR («l'Indice») est un indice de capitalisation (réinvestissement des dividendes nets) calculé et publié par Solactive AG («le Fournisseur d'Indice»). Il est exprimé en dollars américains (USD).

L'indice US ESG Minimum Variance NR reflète la performance d'un échantillon dynamique d'actions qui satisfont aux critères ESG (Environnement, Social et Gouvernance) parmi les plus liquides de l'indice Solactive US Large Cap® («l'Indice de base»), qui reflète quant à lui la performance d'environ 500 grandes entreprises opérant dans les principaux secteurs des États-Unis d'Amérique. Les composantes de l'Indice sont sélectionnées chaque mois et pondérées en fonction d'un processus d'optimisation. Pour cette raison, les expositions de l'Indice aux secteurs et aux sociétés diffèrent de celles de l'Indice de base.

Pour une description détaillée de l'Indice, voir la section «Description de l'Indice» de l'annexe consacrée au Fonds dans le Prospectus.

Politique d'investissement

Afin de réaliser son objectif d'investissement, le Fonds investit principalement, par le biais d'une réplification physique, dans la totalité ou dans une partie des actions incluses dans l'Indice, pour des pondérations quasiment identiques à celles de l'Indice. Le Fonds peut également, dans le respect des intérêts de ses Actionnaires, utiliser des swaps sur indices dans le but de s'exposer à l'Indice par le biais d'une réplification synthétique. En utilisant cette méthode, le Fonds investit dans un portefeuille d'actions et/ou de titres obligataires cotés dans les pays de l'OCDE et émis par des gouvernements ou des entreprises publiques ou privées, dont la performance est échangée contre celle de l'Indice par l'intermédiaire d'un contrat de swap conclu avec une contrepartie de swap. Cette méthode engendre un risque de contrepartie, comme défini à la section «Profil de risque et de rendement» ci-dessous. En conséquence, la valeur d'inventaire nette par action du Fonds augmente (ou diminue) en fonction des variations de l'Indice.

Au moment de l'achat, les titres obligataires doivent être notés *investment grade*, sachant que, en cas de déclassement, le Fonds ne peut détenir des titres inférieurs à la catégorie *investment grade* que de manière accessoire (c'est-à-dire des titres notés en-deçà de BBB- par Standard & Poor's ou en-deçà de Baa3 by Moody's ou, s'ils ne sont pas notés, considérés comme tels par le Gestionnaire Financier). La contrepartie de swap doit être un établissement financier de premier ordre spécialisé dans ce type d'opération. Le Fonds peut conclure de multiples contrats de swap, auprès de contreparties ayant les mêmes caractéristiques susmentionnées.

Le Fonds peut, dans le respect des intérêts de ses Actionnaires, passer, partiellement ou totalement, de l'une à l'autre des politiques d'investissement ci-dessus (réplication synthétique ou physique).

Dans le cadre des deux stratégies de réplification, le Fonds doit en permanence investir au moins 60% de ses actifs en actions ou droits émis par des sociétés dont le siège social est sis dans les pays de l'OCDE.

En outre, à titre accessoire, le Fonds peut utiliser d'autres instruments dérivés à des fins de couverture et d'investissement et effectuer des opérations de prêt et d'emprunt de titres, ainsi que des opérations de pension, comme indiqué dans la section «Recours aux instruments dérivés, techniques d'investissement et de couverture spéciales» du Prospectus.

La Devise de référence du Fonds est le dollar américain (USD).

Les Actions UCITS ETF 1C(USD) sont cotées sur une ou plusieurs places boursières. Les investisseurs peuvent acheter et vendre leurs Actions soit par l'intermédiaire de leur courtier habituel, lors de tout jour de transaction de la ou des place(s) boursière(s) concernée(s) qui est également un jour de transaction au Luxembourg, soit par l'intermédiaire d'une plate-forme de distribution de fonds. Veuillez contacter votre courtier pour des informations complémentaires. La Classe d'Actions UCITS ETF 1C(USD) étant une classe de capitalisation, les revenus tirés du Fonds sont réinvestis. Pour de plus amples renseignements, veuillez lire la section intitulée «Souscription, transfert, conversion et rachat d'Actions» et la section intitulée «Informations pratiques» de l'annexe consacrée au Fonds dans le Prospectus.

Recommandation : ce Fonds pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport dans un délai de moins de cinq ans.

Profil de risque et de rendement

Risque plus faible

Risque plus élevé

Rendement généralement inférieur Rendement généralement supérieur

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|

Le Fonds se classe dans la 4^e catégorie de l'indicateur synthétique de risque et de rendement, qui repose sur des données historiques. En raison de son exposition aux marchés d'actions, le Fonds peut subir une volatilité importante, que son classement dans l'indicateur susmentionné reflète. Les données historiques ne sont pas nécessairement une indication fiable des données futures. La catégorie de risque susmentionnée n'est pas garantie et peut évoluer au fil du temps. Le capital du Fonds n'est pas garanti et sa valeur n'est pas protégée. La catégorie la moins risquée n'est pas totalement exempte de risque.

Risques spécifiques

Risques indicels

La valeur des Actions du Fonds est liée à celle de l'Indice, qui peut augmenter ou diminuer. En conséquence, l'attention des investisseurs est attirée sur le fait que la valeur de leurs placements peut augmenter ou diminuer. En outre, il est impossible de garantir que la méthodologie sous-jacente de l'Indice permettra de dégager un rendement supérieur à celui de toute autre stratégie d'investissement comparable ou que les investisseurs récupéreront leur investissement initial.

Risque lié aux instruments dérivés et aux contreparties

Le Fonds effectuant des opérations de swap, il s'expose potentiellement au risque de contrepartie et d'émetteur. En cas d'insolvabilité ou de défaillance de la contrepartie ou de l'émetteur, le Fonds peut subir une perte.

La valeur des opérations de swap peut varier en fonction de facteurs divers, incluant (sans s'y limiter) le niveau de l'Indice, les taux d'intérêt et la liquidité du marché des actions.

Risque lié à la concentration géographique

Les fonds qui concentrent leurs placements dans certaines régions peuvent encourir des pertes, notamment si l'économie de la région concernée subit des difficultés ou si les investissements deviennent moins attrayants dans cette région. En outre, les marchés sur lesquels un fonds investit peuvent être affectés de manière significative par des conditions politiques, économiques ou réglementaires défavorables.

Veuillez lire la section du Prospectus intitulée «Risques généraux» pour de plus amples renseignements sur les risques.

Frais inhérents au Fonds

Les frais acquittés par les investisseurs servent à couvrir les coûts d'exploitation du Fonds, y compris les coûts de commercialisation et de distribution des actions. Ces frais réduisent la croissance potentielle des investissements.

Frais par Classe d'Actions – Classe d'Actions UCITS ETF 1C (USD)

Frais ponctuels facturés avant ou après l'investissement

| | |
|-------------------------|--|
| Frais d'entrée | Commission de vente maximale 3,00% Commission de réplication maximale sur les souscriptions 1,00% |
| Frais de sortie* | Commission de rachat maximale 3,00% Commission de réplication maximale sur les rachats 1,00 % |

Ces chiffres sont le pourcentage maximal pouvant être déduit des capitaux engagés par l'investisseur avant qu'ils ne soient investis, ou du produit du rachat des placements avant qu'il ne soit versé.

Frais prélevés par le Fonds sur une période d'un an

Frais courants : 0,65% par an
Ratio des frais totaux (TER)

Frais prélevés par le Fonds dans certaines circonstances

Commission de performance : Néant

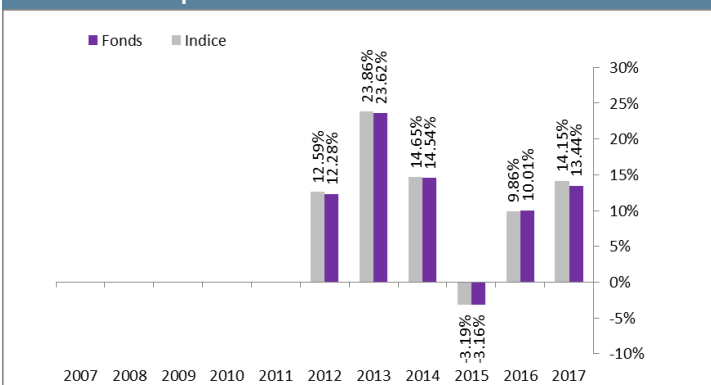
Les frais d'entrée et de sortie indiqués sont des chiffres maximaux. Dans certains cas, l'investisseur paie moins – pour en savoir plus, consultez votre conseiller financier.

* Une taxe supplémentaire pouvant aller jusqu'à 2,00% peut être imposée à tout investisseur pratiquant un négoce excessif ou effectuant des activités de *market timing*.

Concernant les **frais courants**, le chiffre communiqué se fonde sur les frais de l'exercice clos en décembre 2017. Ce montant peut varier d'un exercice à l'autre. Sont exclus de ce montant les frais de transaction du portefeuille, hormis les frais d'entrée ou de sortie payés par la SICAV lors de l'achat ou de la vente de parts d'un autre organisme de placement collectif.

Pour de plus amples renseignements concernant les frais, veuillez lire les chapitres «Charges et dépenses» et «Souscription, transfert, conversion et rachat d'Actions» du prospectus du Fonds, qui est disponible à l'adresse www.ossiam.com.

Performances passées



La performance passée n'est pas un indicateur fiable de la performance future.

Ce diagramme illustre la performance de la Classe d'Actions UCITS ETF 1C (USD), dans sa devise de cotation, nette des frais courants et hors droits d'entrée et de sortie.

L'Indice est calculé en utilisant la performance de l'indice Ossiam US Minimum Variance NR jusqu'au 16 juin 2017 et la performance de l'indice US ESG Minimum Variance NR Index par la suite. Cette méthode de calcul reflète le changement de l'indice de référence entrée en vigueur à la clôture du 16 juin 2017.

Date de création du Fonds : 7 juin 2011

Date de création de la Classe d'Actions: 7 juin 2011

Informations pratiques

Dépositaire et Agent administrateur du Fonds

State Street Bank Luxembourg
49, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

Heure limite de réception des ordres : 16h15 (heure du Luxembourg).

La valeur d'inventaire nette indicative du Fonds peut être consultée à l'adresse www.euronext.com. Des informations relatives au portefeuille du Fonds sont fournies dans les rapports annuels et semestriels du Fonds.

Des informations complémentaires concernant la SICAV et le Fonds (dont la version anglaise du prospectus complet, des rapports et des comptes de la SICAV dans son ensemble), ainsi que la procédure d'échange d'Actions d'un compartiment à un autre compartiment, sont disponibles gratuitement sur demande auprès du siège social de la Société de gestion ou du Dépositaire et Agent administrateur. Le prix par Action du Fonds peut être obtenu à l'adresse www.ossiam.com ou au siège social de la Société de gestion ou de l'Agent administrateur.

De plus amples informations relatives à la politique de rémunération mise à jour de la Société de gestion, y compris une description de la manière dont la rémunération et les avantages sont calculés et octroyés, sont disponibles sur le site Internet www.ossiam.com. Un exemplaire papier gratuit est disponible sur simple demande.

Les actifs et passifs de chaque compartiment étant séparés, les droits des investisseurs et des créanciers relatifs à un compartiment donné sont limités aux actifs de ce compartiment, sauf stipulation contraire dans les documents constitutifs de la SICAV.

Le Fonds peut être assujéti à un régime fiscal spécifique au Luxembourg, ce qui, selon votre pays de résidence, peut avoir un impact sur votre investissement. Pour de plus amples renseignements, veuillez contacter votre conseiller. Ce Fonds satisfait aux critères de « fonds actions au sens de la loi allemande sur l'investissement », tel que décrit à la section fiscalité du Prospectus.

Informations complémentaires

| Classe d'Actions | ISIN | Types d'investisseurs | Devise | Souscription minimum | Rachat minimum | Participation minimum | Politique de dividendes | TER |
|-------------------|--------------|-----------------------------|--------|----------------------|----------------|-----------------------|-------------------------|-------|
| UCITS ETF 1C(USD) | LU0599612412 | Tous types d'investisseurs* | USD | 1 000 000 USD | 1 000 000 USD | 100 000 USD | Capitalisation | 0,65% |

* Souscriptions sur le marché primaire uniquement pour les participants agréés et les investisseurs approuvés.

La responsabilité d'Ossiam ne peut être engagée que sur la base de déclarations contenues dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du prospectus du Fonds.

Ce Fonds est agréé au Luxembourg et réglementé par la Commission de Surveillance du Secteur Financier.

Ossiam est agréé en France et réglementé par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF).

Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 31 juillet 2018.