

OSSIAM STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE L'ETF

Le fonds OSSIAM STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR a pour objectif de répliquer, à la hausse comme à la baisse, l'évolution (dividendes net réinvestis) de l'indice de stratégie STOXX® Europe 600 Equal Weight NR, nette des frais supportés par le fonds (TER).

DESCRIPTION DE L'INDICE

L'indice de stratégie STOXX® Europe 600 Equal Weight NR est calculé en euro et publié en temps réel par STOXX Ltd. Il comprend les 600 valeurs de l'indice STOXX® Europe 600 NR et alloue le même poids à chaque société entrant dans sa composition (0,1667% dans des circonstances normales) à chaque date d'ajustement (3ème vendredi des mois de mars, juin, septembre et décembre).

STRATÉGIE EQUAL WEIGHT

Un indice de stratégie équi-pondéré est composé des mêmes titres que son indice de référence. Cependant, il attribue le même poids à chacune des valeurs à chaque date de rebalancement et ce quelle que soit la taille des sociétés qui entrent dans sa composition (taille mesurée dans l'indice de référence par la capitalisation boursière). Il vise à offrir aux investisseurs une alternative à l'indice pondéré par la capitalisation boursière, en atténuant les effets de concentration sur un petit nombre de valeurs.

CARACTÉRISTIQUES DE L'ETF

Places de cotation	Euronext Paris, Xetra, Borsa Italiana, SIX Swiss Exchange, LSE
AUM Classe d'action	87 698 792,25 (EUR)
AUM Total Fonds	87 698 792,25 (EUR)
NAV	85,088 (EUR)
Nombre d'actions	1 030 683,00
Fréquence de rebalancement	Trimestrielle
Mode de réplcation	Synthétique
SRD	Oui
PEA	Oui
Dividendes	Réinvestis
TER annuel	0,35%
Investissement minimum	1 action
Classe d'action	1C
ISIN	LU0599613147

Structure juridique	SICAV luxembourgeoise
Date de lancement	16/05/2011
Fréquence calcul NAV	Quotidienne
Dépositaire	State Street Bank Luxembourg S.A.
Devise	EUR
Cut-off	15:30

Source : Bloomberg/STOXX, calculs effectués par Ossiam

TOP 10 DES VALEURS (31/08/2017)

STOXX® Europe 600 Equal Weight index NR (EUR)

FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	0,23%
NORSK HYDRO ASA	0,22%
WORLDPAY GROUP PLC	0,22%
ANGLO AMERICAN PLC	0,21%
STOREBRAND ASA	0,21%
Nets A/S	0,21%
ANTOFAGASTA PLC	0,21%
INDVIOR PLC	0,21%
STADA ARZNEIMITTEL AG	0,21%
BOLIDEN AB	0,21%

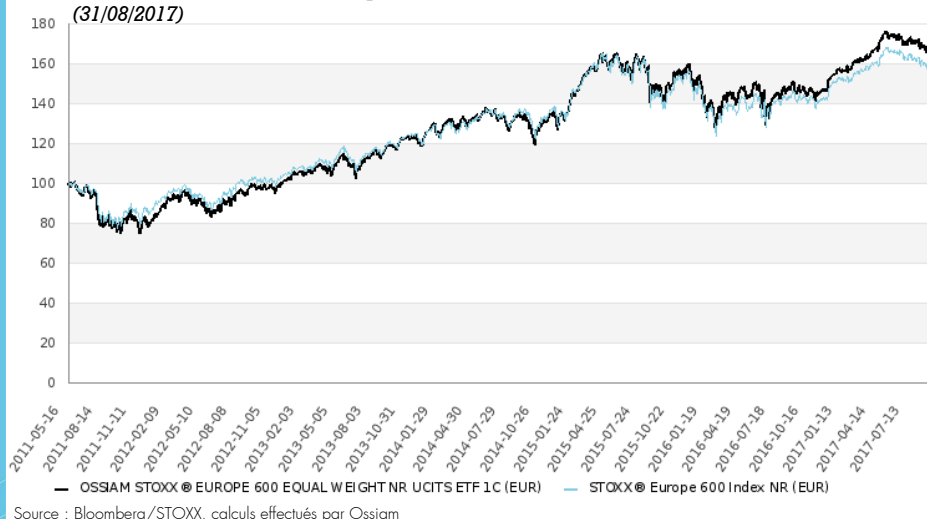
Source : Bloomberg/STOXX, calculs effectués par Ossiam

STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)

NESTLE S-REG	2,77%
NOVARTIS AG-REG	2,20%
HSBC HOLDINGS PLC	2,07%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,87%
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,71%
TOTAL SA	1,35%
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,30%
BP PLC	1,19%
SANOFI	1,17%
SIEMENS AG-REG	1,17%

Source : Bloomberg/STOXX, calculs effectués par Ossiam

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



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

	OSSIAM STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR UCITS ETF 1C (EUR)	STOXX® Europe 600 Equal Weight index NR (EUR)	STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)
YTD	8,53	8,48	5,82
1 an	14,57	14,49	11,80
3 ans annualisés	8,13	8,17	5,86
5 ans annualisés	12,23	12,32	10,02
Depuis le lancement	68,48	69,46	59,86

Source : Bloomberg/STOXX, calculs effectués par Ossiam

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

	OSSIAM STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR UCITS ETF 1C (EUR)	STOXX® Europe 600 Equal Weight index NR (EUR)	STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)
Volatilité annualisée (%)	17,40	17,41	16,87
Corrélation vs univers	0,98	0,98	-
Drawdown maximum (%)	-25,75	-25,70	-25,21
Alpha	0,01	0,01	-
Bêta	1,01	1,01	-
Ratio de Sharpe	0,49	0,50	0,46
Tracking Error (%)	0,07	0,00	-

Source : Bloomberg/STOXX, 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.

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

	STOXX® Europe 600 Equal Weight index NR (EUR)	STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)
Small	0,33	0,19
Mid	13,90	2,45
Large	85,78	97,36

Source : Bloomberg/STOXX, calculs effectués par Ossiam

PARTICIPANTS AUTORISÉS :

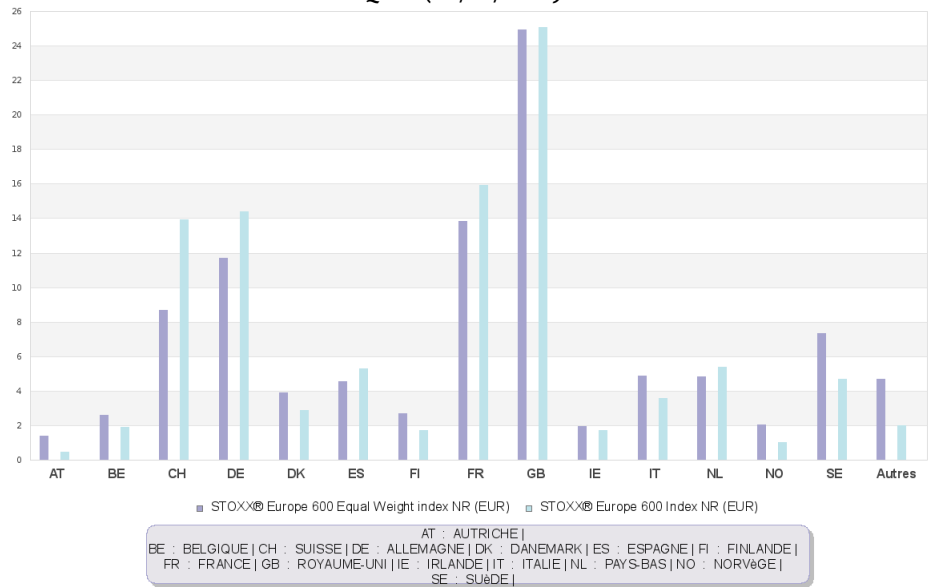
Baader Bank AG	+49 69 13881 333
Banca IMI	+39 027 261 5318
BOAML	+44 207 996 1034
Barclays	+44 203 134 8021
BNP Paribas	+44 207 595 8998
Commerzbank	+49 69 136 22 088
Crédit Suisse	+44 207 888 6549
Deutsche Bank	+44 207 547 5147
Flow Traders	+31 20 799 6777
Intermonte	+39 02 7711 5203
Jane Street	+44 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 :

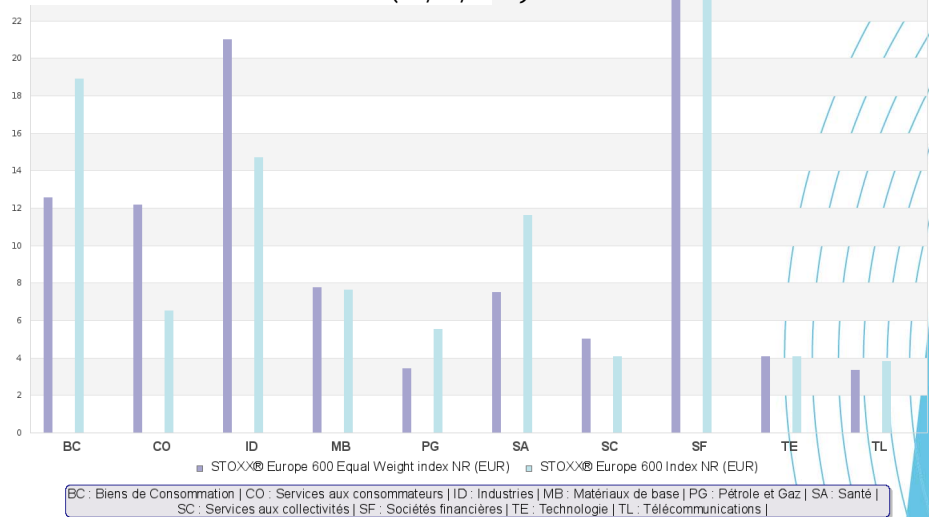
Société de gestion	Ossiam
--------------------	--------

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)



RÉPARTITION SECTORIELLE (31/08/2017)



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 STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 17/06/2011. Avant le 20 mai 2016, NGAM S.A. a agi en tant que société de gestion de la SICAV. 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. Le fonds OSSIAM STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR n'est en aucune façon sponsorisé, avalisé, vendu ou promu par STOXX. STOXX n'aura aucune responsabilité pour les éventuelles erreurs, omissions ou interruptions de l'indice STOXX® Europe 600 Equal Weight NR.