

OSSIAM US MINIMUM VARIANCE ESG NR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE L'ETF

Le fonds a pour objectif de répliquer l'évolution, à la hausse comme à la baisse, de l'indice de stratégie US ESG Minimum Variance Index NR. Jusqu'au 16 Juin 2017, le fonds s'appelait OSSIAM US MINIMUM VARIANCE NR et répliquait l'indice de stratégie Ossiam US Minimum Variance Index NR. Cela reflète le changement de référence qui est entré en vigueur sur le fonds le 16 juin 2017.

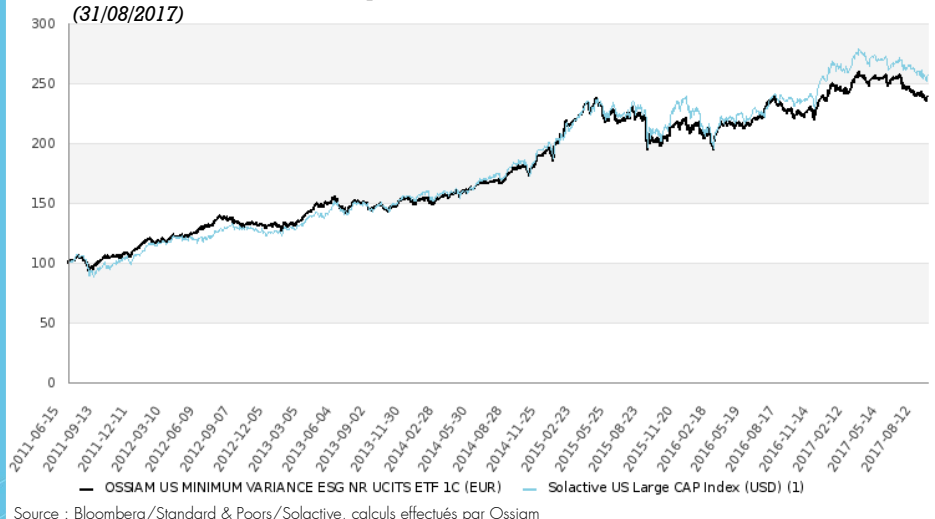
DESCRIPTION DE L'INDICE

L'indice de stratégie US ESG Minimum Variance Index NR reflète la performance de l'univers d'investissement Solactive US Large Cap satisfaisant des critères ESG (l'Environnement, le Social, et la Gouvernance) parmi les plus liquides pondérées de façon à minimiser la volatilité du portefeuille.

STRATÉGIE MINIMUM VARIANCE ESG

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. Cette stratégie est ici dotée d'un filtre ESG avec un processus de sélection de 70% des actions les mieux classées par secteurs (GICS) selon des critères ESG retenus par le Fournisseur ESG (Sustainalytics) et d'un processus d'élimination de 30% d'actions des sociétés considérées comme non conformes (suite à des problèmes éthiques ou de corruption) et des sociétés ayant une note de 0 sur 100 sur un des 10 critères éliminatoires parmi les environ 290 critères définis et évalués par Sustainalytics.

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



Source : Bloomberg/Standard & Pooors/Solactive, calculs effectués par Ossiam

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

	OSSIAM US MINIMUM VARIANCE ESG NR UCITS ETF 1C (EUR)	US ESG Minimum Variance Index NR (EUR) (1)	Solactive US Large CAP Index (USD) (1)
YTD	-1,70	-1,32	-1,16
1 an	5,07	5,42	8,16
3 ans annualisés	10,78	10,88	12,58
5 ans annualisés	12,45	12,58	14,93
Depuis le lancement	139,59	141,91	157,57

Source : Bloomberg/Standard & Pooors/Solactive, calculs effectués par

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

	OSSIAM US MINIMUM VARIANCE ESG NR UCITS ETF 1C (EUR)	US ESG Minimum Variance Index NR (EUR) (1)	Solactive US Large CAP Index (USD) (1)
Volatilité annualisée (%)	13,44	13,44	16,14
Corrélation vs univers	0,93	0,93	-
Drawdown maximum (%)	-18,13	-18,16	-18,41
Alpha	0,02	0,03	-
Bêta	0,78	0,78	-
Ratio de Sharpe	1,12	1,13	1,02
Tracking Error (%)	0,08	0,00	-

Source : Bloomberg/Standard & Pooors/Solactive, calculs effectués par C

CARACTÉRISTIQUES DE L'ETF

Places de cotation	Euronext Paris, Xetra, Borsa Italiana, SIX Swiss Exchange
AUM Classe d'action	137 474 503,08 (EUR)
AUM Total Fonds	467 398 211,75 (USD)
NAV	160,710 (EUR)
Nombre d'actions	855 419,00
Fréquence de rebalancement	Mensuelle
Mode de réplcation	Physique
SRD	Oui
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
TER annuel	0,65%
Investissement minimum	1 action
Classe d'action	1C
ISIN	LU0599612685

Structure juridique	SICAV luxembourgeoise
Date de lancement	15/06/2011
Fréquence calcul NAV	Quotidienne
Dépositaire	State Street Bank Luxembourg S.A.
Devise	EUR
Cut-off	16:15

	Reuters	Bloomberg
iNAV	ISPMVINAV.PA	ISPMV
Euronext Paris	SPMV.PA	SPMV FP

Source : Bloomberg/Standard & Pooors/Solactive, calculs effectués par Ossiam

TOP 10 DES VALEURS (31/08/2017)

US ESG Minimum Variance Index NR (EUR) (1)

TIME WARNER INC	4,44%
COCA-COLA CO/THE	3,75%
ABBVIE INC	3,47%
HERSHEY CO/THE	3,16%
Allergan PLC	2,95%
PFIZER INC	2,86%
IHS Markit Ltd	2,85%
UNITED TECHNOLOGIES CORP	2,63%
WASTE MANAGEMENT INC	2,61%
CONSOLIDATED EDISON INC	2,60%

Source : Bloomberg/Standard & Pooors/Solactive, calculs effectués par Ossiam

Solactive US Large CAP Index (USD) (1)

APPLE INC	3,75%
MICROSOFT CORP	2,70%
FACEBOOK INC-A	1,92%
AMAZON.COM INC	1,87%
JOHNSON & JOHNSON	1,71%
EXXON MOBIL CORP	1,54%
JPMorgan Chase & Co	1,54%
ALPHABET INC-CL A	1,36%
ALPHABET INC-CL C	1,35%
BANK OF AMERICA CORP	1,13%

Source : Bloomberg/Standard & Pooors/Solactive, 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. (1) L'indice de référence (ainsi que son Benchmark) est calculé en utilisant la performance de l'indice Ossiam US Minimum Variance NR (resp. S & P 500 Index NR) jusqu'au 16 juin 2017 et la performance de l'US ESG Minimum Variance NR Index (resp. NR Solactive US Large CAP Index) par la suite. Cela reflète le changement de référence qui est entré en vigueur sur le fonds le 16 juin 2017.

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

	US ESG Minimum Variance Index NR (EUR) (1)	Solactive US Large CAP Index (USD) (1)
Small	1,83	0,24
Mid	0	0
Large	98,17	99,74

Source : Bloomberg/Standard & Poors/Solactive, calculs effectués par Ossiam

PARTICIPANTS AUTORISÉS :

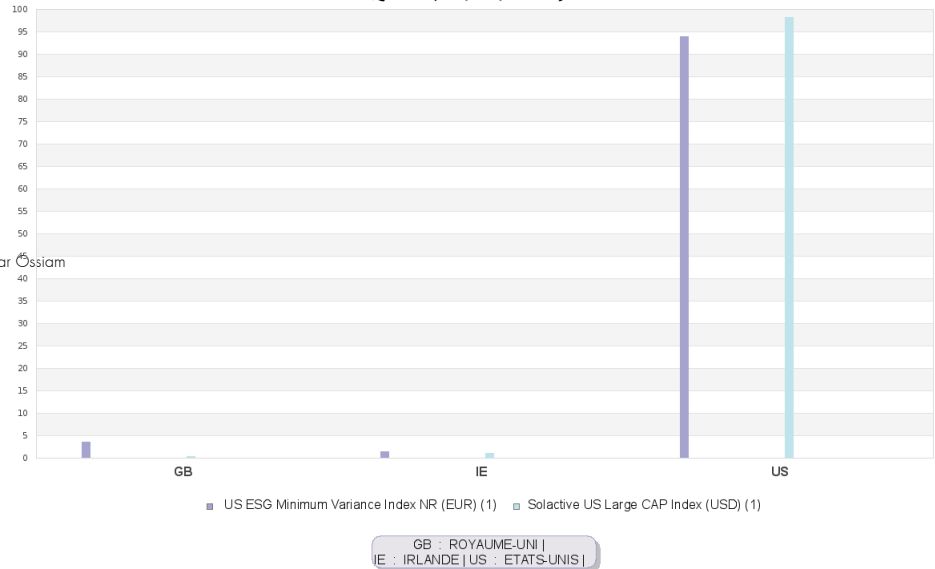
Baader Bank AG	+49 69 13881 333
Banca IMI	+39 027 261 5318
BOAML	+44 207 996 1034
Barclays	+44 203 134 8021
BNP Paribas	+44 207 595 8998
Commerzbank	+49 69 136 22 088
Crédit Suisse	+44 207 888 6549
Deutsche Bank	+44 207 547 5147
Flow Traders	+31 20 799 6777
Intermonte	+39 02 7711 5203
Jane Street	+44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

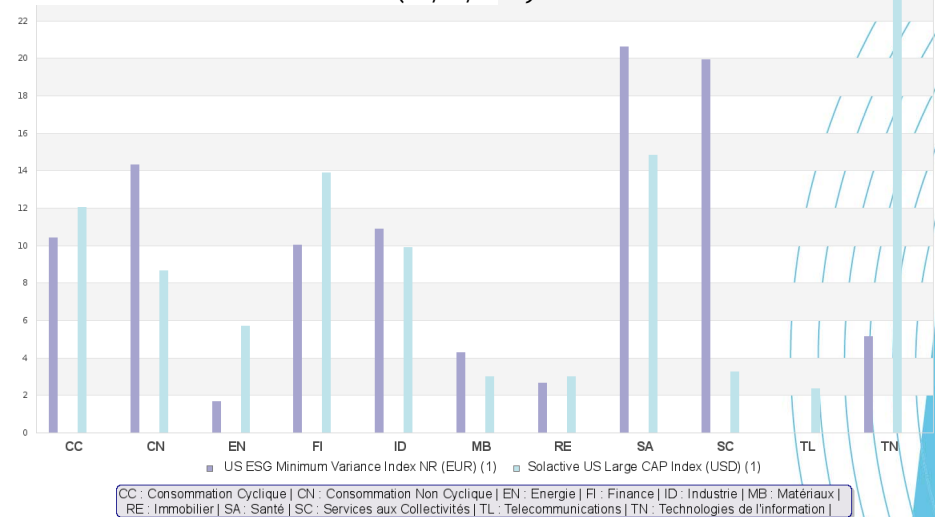
RÉPARTITION GÉOGRAPHIQUE (31/08/2017)



Source : Bloomberg/Standard & Poors/Solactive, calculs effectués par Ossiam

Allocation basée sur le champs Bloomberg "Country of Incorporation"

RÉPARTITION SECTORIELLE (31/08/2017)



Source : Bloomberg/Standard & Poors/Solactive, 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 US MINIMUM VARIANCE ESG NR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 17/06/2011. 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 etc.) afin d'avoir une vision d'ensemble des opportunités et des risques liés à une exposition sur cet indice de stratégie. L'instrument financier n'est ni parrainé, ni approuvé, ni vendu ou préconisé par Solactive AG, Solactive AG n'offre aucune garantie ou assurance que ce soit concernant l'Indice lui-même ou l'utilisation de l'Indice à tout moment. L'Indice de stratégie est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait de son mieux pour que l'indice soit correctement calculé. Indépendamment de ses obligations envers l'Emetteur, Solactive AG n'a aucune obligation de signaler les erreurs de l'indice à des tiers, y compris mais sans s'y limiter à des investisseurs et / ou des intermédiaires financiers de l'instrument financier. Ni la publication de l'Indice par Solactive AG ni la licence de l'Indice ou la marque de l'Indice à des fins d'utilisation dans le cadre de l'instrument financier ne constitue une recommandation de Solactive AG d'investir des capitaux dans ledit instrument financier et ne représente en aucune manière une assurance ou l'opinion de Solactive AG à l'égard de tout investissement dans cet instrument financier. Rappelez-vous, les informations contenues dans ce document ne constituent pas une recommandation d'achat ou de vente de titres. Les informations et opinions contenues dans ce document ont été obtenues auprès de sources publiques considérées comme fiables, mais aucune représentation ou garantie, expresse ou implicite, n'est faite sur exactitude des informations présentes.