

Au 30.11.2023

OSSIAM EUROPE ESG MACHINE LEARNING UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

L’objectif du fonds d’investissement d’Ossiam Europe ESG Machine Learning est de générer le rendement total net d’une sélection d’actions cotées en Europe. Le fonds est géré activement et n’utilisera son indice de référence, le Solactive Europe 600 Index NTR qu’à des fins de comparaison des performances et des émissions de carbone. La composition du portefeuille du fonds n’est donc pas contrainte par l’indice de référence et peut s’écarter significativement des constituants de l’indice de référence et peut s’écarter significativement des constituants de l’indice de référence.

Le processus d’investissement du fonds est systématique. Plusieurs filtres ESG sont en place pour exclure les entreprises :

- Impliquées dans les secteurs controversés de l’armement, du tabac ou du charbon ;
- Qui font l’objet de graves controverses ESG ;
- Qui sont en violation d’au moins un principe du Pacte mondial de l’ONU ;
- Qui sont dans la liste d’exclusion du Norges Bank Investment Management.

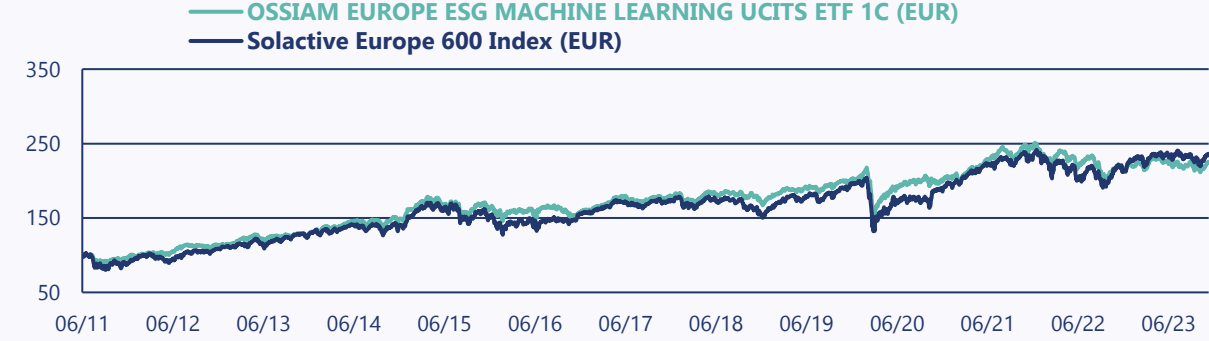
Les actions restantes sont ensuite classées comme opportunités ou risques financiers en fonction de leur profil ESG par l’algorithme de machine learning d’Ossiam. Le portefeuille final est composé de titres qualifiés d’opportunités, pondérés de manière à réduire au minimum la volatilité et à atteindre les objectifs ESG ci-dessous.

La note ESG du portefeuille doit être supérieure de 10% par rapport à l’univers d’investissement, avec une réduction de 40% des gaz à effet de serre, une intensité carbone plus faible (mesurée par la quantité totale émise de gaz à effet de serre divisée par le revenu de l’entreprise) et une réduction des émissions provenant des réserves de combustibles fossiles.

Avantages:

- L’utilisation du machine learning pour détecter les opportunités financières dans les données ESG
- Un profil risque/rendement amélioré
- Une politique ESG multidimensionnelle basée sur des filtres d’exclusions normatifs et une réduction significative de l’empreinte carbone.

PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT



PERFORMANCES NETTES

	Perf. 1 mois %	Perf. depuis Jan. %	Perf. 1 an %	Perf. 3 ans ann. %	Perf. 5 ans ann. %	Ann. depuis création %
Fonds	5,62	5,35	2,84	4,28	4,64	6,76
Univers d'investissement	6,70	11,49	7,71	8,19	7,72	7,16

Données calculées par Ossiam au 30.11.2023. Source: Ossiam, Refinitiv.

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité Ann. %	Apha Ann. %	Beta	Tracking Error %	Ratio de Sharpe	Perte Max. %
Fonds	12,53	1,96	0,67	0,11	0,54	-31,00
Univers d'investissement	16,86	---	---	---	0,42	-35,36

Données calculées par Ossiam au 30.11.2023. Source: Ossiam, Refinitiv.

INFORMATIONS IMPORTANTES: Les performances sont nettes des frais de gestion. 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 marché qui peuvent être différents de la valeur liquidative de l'ETF. **Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.**

Risques spécifiques: L’indice de référence n’a pas vocation à être aligné aux ambitions environnementales ou sociales telles que promues par le Fonds.Veuillez noter que le fonds est soumis à des risques spécifiques tels que le risque d’investissement ESG, le risque de concentration géographique en plus du risque de perte en capital et du risque de marché. Veuillez lire la section du prospectus intitulée "Risques généraux" pour de plus amples renseignements sur les risques. Ce Fonds promeut des critères environnementaux ou sociaux et de gouvernance (ESG) mais il n'a pas pour objectif un investissement durable. Il pourra investir partiellement dans des actifs ayant un objectif durable, par exemple tels que définis par la classification de l'UE.

*Le fonds est passé d’un ETF géré passivement à un ETF géré activement qui promeut des caractéristiques ESG. Le fonds a changé de nom, d’indice et de benchmark: Auparavant Ossiam iSTOXX® Europe Minimum Variance NR est désormais Ossiam Europe ESG Machine Learning ; L’indice de référence (resp. l’univers d’investissement) était iSTOXX® Europe Minimum Variance NR (resp. STOXX® Europe 600 Index) jusqu’au 22 mai 2021 et est maintenant Ossiam Europe ESG Machine Learning (resp. Solactive Europe 600 Index NTR).

Veuillez noter que si la devise du fonds/classe d’actions est différente de la devise locale de l’investisseur, les variations du taux de change entre les deux devises affecteront les pertes ou gains générés par le fonds ou la classe d’actions.

INDICATEUR DE RISQUE



La Catégorie d’actions est classée au niveau 4 sur l’échelle synthétique de l’indicateur de risque, qui repose sur des données historiques. En raison de son exposition aux marchés d’actions, le Fonds pourra subir une volatilité importante, que son classement dans l’indicateur susmentionné reflète. Les données historiques peuvent ne pas constituer un indicateur fiable de la performance future. La catégorie de risque indiquée n’est pas garantie et peut évoluer. Il n’existe aucune garantie du capital ni de protection sur la valeur du Fonds. La catégorie inférieure n’est pas synonyme d’« absence de risque ».Vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement. La catégorie inférieure n’est pas synonyme d’« absence de risque ».

CARACTÉRISTIQUE DE L'UNIVERS D'INVESTISSEMENT

Nom	Solactive Europe 600 Index (EUR)
Ticker Bloomberg	EU600N Index
Date de lancement	08.05.2006
Classe d'actifs	Action
Fréquence de rebalancement	Mensuelle

DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Structure juridique	Compartiment de l'Ossiam Lux SICAV
UCITS	Oui
Classification SFDR	Article 8
Catégorie	ETF géré activement
PEA	Oui
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	EUR 68 118 414
Encours total de la part	EUR 28 435 333
Valeur liquidative	EUR 218.024
Nombre de parts	130 423
Devise du fonds	EUR
Devise de la part	EUR
ISIN	LU0599612842
Date de lancement	21.06.2011
Méthode de réplcation	Physique
TER (frais/an)	0.65%

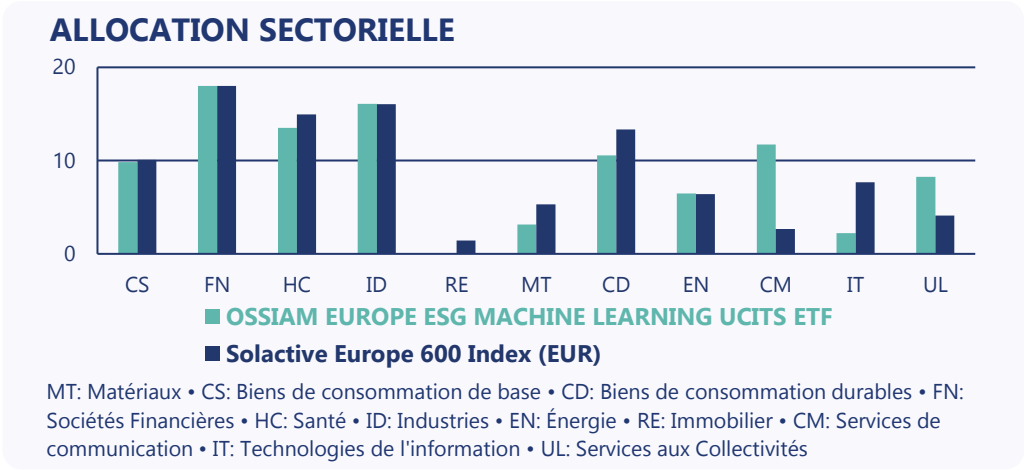
INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire ¹)	15h00 (heure du Luxembourg)
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action

¹Souscriptions sur le marché primaire réservées aux participants autorisés et investisseurs habilités

London Exchange en EUR	EUMV LN
London Exchange en GBP	LEMV LN
XETRA en EUR	OSX4 GY
SIX Swiss Exchange en EUR	EUMV SW
Borsa Italiana en EUR	EUMV IM

STRICTEMENT RÉSERVÉ AUX INVESTISSEURS PROFESSIONNELS OU NON PROFESSIONNELS INVESTIS DANS LE FONDS.
VEUILLEZ VOUS RÉFÉRER AU PROSPECTUS DU FONDS ET AU DOCUMENT D’INFORMATIONS CLÉS POUR L’INVESTISSEUR AVANT DE PRENDRE TOUTE DÉCISION FINALE D’INVESTISSEMENT.



Données calculées par Ossiam au 30.11.2023. Source: Ossiam, Refinitiv.

TOP 10 DES VALEURS

	Ossiam Europe ESG Machine Learning UCITS ETF	Solactive Europe 600 Index
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	4.10%	0.44%
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4.05%	0.56%
E.ON SE	3.73%	0.28%
GSK PLC	3.73%	0.71%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.66%	1.84%
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3.64%	0.47%
DEUTSCHE BOERSE AG	3.63%	0.34%
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3.57%	0.75%
ORANGE	3.17%	0.22%
EQUINOR ASA	2.58%	0.27%

Données calculées par Ossiam au 30.11.2023. Source: Ossiam, Refinitiv.

CONTACT / INFO

www.ossiam.com
mail: info@ossiam.com
Tel: +33 1 84 79 42 70
36 rue Brunel
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 de la Commission de Surveillance du Secteur Financier du grand-duché du Luxembourg. 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 Bank International GmbH, Luxembourg Branch, 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, est agréée par l'Autorité des Marchés Financiers en qualité de Société de Gestion de Portefeuille sous le numéro GP-10000016. Ossiam, dont le siège social est situé au 6 place de la Madeleine – 75008 Paris, est immatriculée au RCS de Paris sous le n° 512 855 958.

Le fonds Ossiam Europe ESG Machine Learning (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 17/06/2011.Pour les investisseurs basés en Suisse : le représentant des fonds et agent payeur est RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Succursale de Zurich, Bleicherweg 7, 8027 Zurich.

Investissements ESG – Limites méthodologiques : En utilisant des critères ESG dans la politique d'investissement, l'objectif du Fonds concerné est en particulier de mieux gérer le risque de durabilité. Les critères ESG peuvent être générés à l'aide des modèles propriétaires, des modèles et des données de tiers ou d'une combinaison des deux. Les critères d'évaluation peuvent évoluer dans le temps ou varier en fonction du secteur ou de l'industrie dans lequel l'émetteur concerné opère. L'application de critères ESG au processus d'investissement peut conduire le Gestionnaire financier à investir ou à exclure des titres pour des raisons non financières, quelles que soient les opportunités de marché disponibles. Les données ESG reçues de tiers peuvent être incomplètes, inexactes ou indisponibles de temps à autre. En conséquence, il existe un risque que le Gestionnaire financier évalue incorrectement un titre ou un émetteur, entraînant l'inclusion ou l'exclusion directe ou indirecte incorrecte d'un titre dans le portefeuille d'un Fonds.

Risque de durabilité : Ce Fonds est sujet à des risques de durabilité tels que définis à l'article 2(22) du Règlement (UE) 2019/2088, par un événement ou une situation dans le domaine environnemental, social ou de la gouvernance qui, s'il survient, pourrait avoir une incidence négative importante, réelle ou potentielle, sur la valeur de l'investissement. Pour plus d'informations sur le dispositif d'intégration du risque de durabilité veuillez vous référer au site internet de la Société de gestion et du gérant financier.

La politique de vote et d'engagement est disponible sur notre site www.ossiam.com

Veuillez vous référer aux prospectus et au site internet du gérant financier pour plus d'informations sur la méthodologie d'évaluation ESG du Fonds.

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.

Pour plus d'informations sur la méthodologie de l'indice : <https://www.ossiam.com/strategies/see>

STRICTEMENT RÉSERVÉ AUX INVESTISSEURS PROFESSIONNELS OU NON PROFESSIONNELS INVESTIS DANS LE FONDS.
VEUILLEZ VOUS RÉFÉRER AU PROSPECTUS DU FONDS ET AU DOCUMENT D'INFORMATIONS CLÉS POUR L'INVESTISSEUR AVANT DE PRENDRE
TOUTE DÉCISION FINALE D'INVESTISSEMENT.



Le présent document est fourni uniquement à des fins d’information aux prestataires de services d’investissement ou aux autres Clients Professionnels ou Investisseurs Qualifiés et, lorsque la réglementation locale l’exige, uniquement sur demande écrite de leur part. Le présent document ne peut pas être utilisé auprès des clients non-professionnels. Il relève de la responsabilité de chaque prestataire de services d’investissement de s’assurer que l’offre ou la vente de titres de fonds d’investissement ou de services d’investissement de tiers à ses clients respecte la législation nationale applicable.

Pour obtenir un résumé des droits des investisseurs dans la langue officielle de votre juridiction, veuillez consulter la section de documentation légale du site web (im.natixis.com/intl/intl-fund-documents)

En France: Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers International - Société de gestion de portefeuilles agréée par l’Autorité des Marchés Financiers sous le n° GP 90-009, société anonyme immatriculée au RCS de Paris sous le numéro 329 450 738. Siège social: 43 avenue Pierre Mendès France, 75013 Paris.

Au Luxembourg: Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers S.A. – Société de gestion luxembourgeoise agréée par la Commission de Surveillance du Secteur Financier, société anonyme immatriculée au RCS de Luxembourg sous le numéro B115843. 2, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg.

En Belgique: Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers S.A., Belgian Branch, Gare Maritime, Rue Picard 7, Bte 100, 1000 Bruxelles, Belgique

En Suisse: Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers, Switzerland Sàrl, Rue du Vieux Collège 10, 1204 Genève, Suisse ou son bureau de représentation à Zurich, Schweizergasse 6, 8001 Zürich.

Les entités susmentionnées sont des unités de développement commercial de Natixis Investment Managers, la holding d’un ensemble divers d’entités de gestion et de distribution de placements spécialisés présentes dans le monde entier. Les filiales de gestion et de distribution de Natixis Investment Managers mènent des activités réglementées uniquement dans et à partir des pays où elles sont autorisées. Les services qu’elles proposent et les produits qu’elles gèrent ne s’adressent pas à tous les investisseurs dans tous les pays.

Bien que Natixis Investment Managers considère les informations fournies dans le présent document comme fiables, y compris celles des tierces parties, elle ne garantit pas l’exactitude, l’adéquation ou le caractère complet de ces informations.

La remise du présent document et/ou une référence à des valeurs mobilières, des secteurs ou des marchés spécifiques dans le présent document ne constitue en aucun cas un conseil en investissement, une recommandation ou une sollicitation d’achat ou de vente de valeurs mobilières, ou une offre de services. Les investisseurs doivent examiner attentivement les objectifs d’investissements, les risques et les frais relatifs à tout investissement avant d’investir. Les analyses et les opinions mentionnées dans le présent document représentent le point de vue de (des) l’auteur (s) référencé(s). Elles sont émises à la date indiquée, sont susceptibles de changer et ne sauraient être interprétées comme possédant une quelconque valeur contractuelle.

Le présent document ne peut pas être distribué, publié ou reproduit, en totalité ou en partie.

Tous les montants indiqués sont exprimés en USD, sauf indication contraire.

Natixis investment managers peut décider de cesser la commercialisation de ce fonds conformément à la législation applicable

