

Au 28.03.2024

Ossiam US ESG Low Carbon Equity Factors UCITS ETF - 1A (USD)

DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

La stratégie Ossiam US ESG Low Carbon Equity Factors a pour objectif d'améliorer le profil rendement/risque d'un portefeuille d'actions américaines évaluées sur la base de leur exposition aux facteurs : Momentum, Taille, Value et Volatilité et leurs caractéristiques ESG (Environnement, Social, Gouvernance).

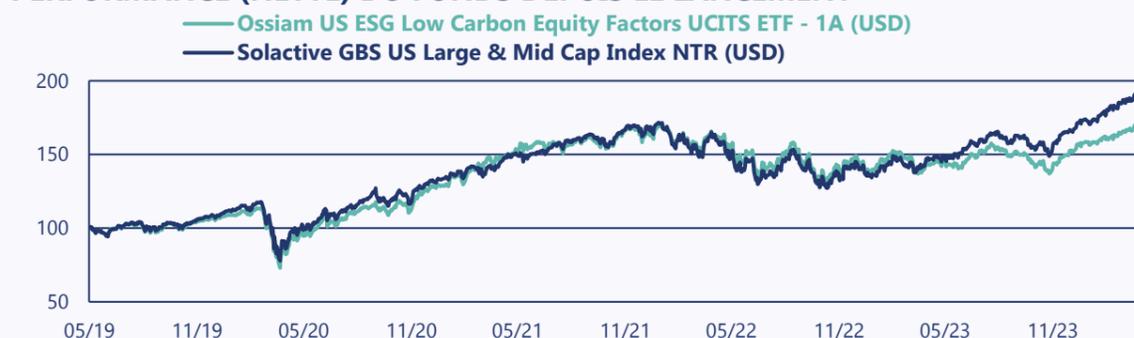
Le processus d'investissement est systématique. Dans un premier temps, la stratégie sélectionne, à hauteur de 80%, les sociétés dont les scores ESG sont les plus élevés puis exclut celles qui ne respectent pas un ensemble prédéfini de critères tels que l'implication dans des secteurs controversés.

Dans un second temps, la stratégie utilise les actions issues de ce filtre pour construire deux portefeuilles distincts. Le premier sélectionne les actions les plus exposées aux facteurs susmentionnés et pondère ces actions en fonction de leur exposition à ces facteurs d'une part, mais aussi de sorte à réduire l'empreinte carbone par rapport à l'univers d'investissement d'autre part. Dans le deuxième portefeuille, la stratégie évalue les secteurs par rapport aux facteurs Value et Momentum. La pondération de ces secteurs est également fonction de leur exposition à ces deux facteurs et de l'objectif de réduction de l'empreinte carbone du portefeuille final par rapport à l'univers d'investissement. Les deux portefeuilles sont pondérés à hauteur de 50% chacun dans le portefeuille final.

Avantages:

- Une exposition à des actions américaines sélectionnées en fonction de leur exposition factorielle et profil ESG
- Un objectif de performance stable et durable sur le long terme avec un tracking error contrôlé.
- Une pondération dynamique basée sur quatre facteurs établis : Momentum, Taille, Value et Volatilité
- Un profil ESG amélioré et une réduction significative de l'empreinte carbone

PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT



Données calculées par Ossiam au 28.03.2024. Source: Ossiam, Solactive AG, Trucost et Sustainalytics.

PERFORMANCES NETTES

	Perf. 1 mois %	Perf. depuis Jan. %	Perf. 1 an %	Perf. 3 ans ann. %	Perf. 5 ans ann. %	Ann. depuis création %
Fonds	3,75	8,16	22,24	4,98	---	11,59
Univers d'investissement	3,04	10,28	34,63	10,36	14,66	14,11

Données calculées par Ossiam au 28.03.2024. Source: Ossiam, Solactive AG, Trucost et Sustainalytics.

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité Ann. %	Apha Ann. %	Beta	Ratio de Sharpe	Perte Max. %
Fonds	21,17	-1,59	0,93	0,45	-35,77
Univers d'investissement	21,65	---	---	0,56	-33,97

Données calculées par Ossiam au 28.03.2024. Source: Ossiam, Solactive AG, Trucost et Sustainalytics.

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.

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 5 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 GBS US Large & Mid Cap Index NTR (USD)
Ticker Bloomberg	SUSLMCN Index
Date de lancement	08.05.2017
Classe d'actifs	Action
Fréquence de rebalancement	Trimestriel

DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Structure juridique	Compartiment de l'Ossiam IRL ICAV
UCITS	Oui
Classification SFDR	Article 8
Catégorie	ETF géré activement
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	USD 82 710 632
Encours total de la part	USD 77 762 330
Valeur liquidative	USD 171.311
Nombre de parts	453 926
Devise du fonds	USD
Devise de la part	USD
ISIN	IE00JB LDJ48
Date de lancement	02.05.2019
Méthode de réplification	Physique
TER (frais/an)	0.45%

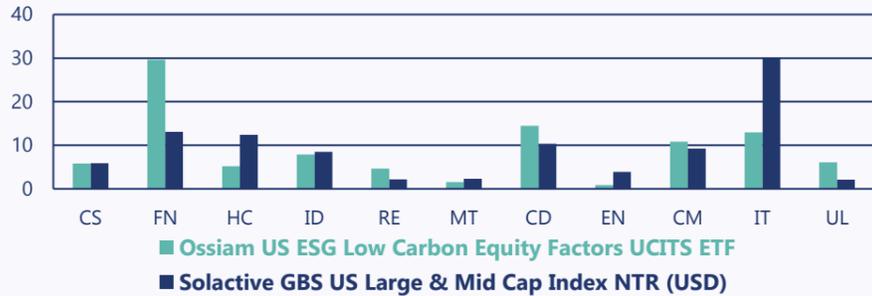
INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

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

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

London Exchange en USD	OUFU LN
London Exchange en GBP	LOUF LN
XETRA en USD	OUFU GY

ALLOCATION SECTORIELLE



MT: Matériaux • CS: Biens de consommation de base • CD: Biens de consommation durables • FN: Sociétés Financières • HC: Santé • ID: Industries • EN: Énergie • RE: Immobilier • CM: Services de communication • IT: Technologies de l'information • UL: Services aux Collectivités

Données calculées par Ossia au 28.03.2024. Source: Ossia, Solactive AG, Trucost et Sustainalytics.

TOP 10 DES VALEURS

	Ossia US ESG Low Carbon Equity Factors UCITS ETF	Solactive GBS US Large & Mid Cap Index NTR
JPMORGAN CHASE & CO	1.95%	1.32%
MICROSOFT CORP	1.31%	7.00%
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1.29%	0.40%
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1.21%	0.01%
TESLA INC	1.18%	1.10%
AT&T INC	1.09%	0.29%
APPLE INC	1.06%	5.76%
HOME DEPOT INC/THE	0.99%	0.87%
NEXTERA ENERGY INC	0.98%	0.29%
BATH & BODY WORKS INC	0.94%	---

Données calculées par Ossia au 28.03.2024. Source: Ossia, Solactive AG, Trucost et Sustainalytics.

CONTACT / INFO

www.ossiam.com
 mail: info@ossiam.com
 Tel: +33 1 84 79 42 70
 36 rue Brunel
 75017 PARIS - FRANCE

Il s'agit d'une communication marketing. Veuillez vous référer au prospectus de l'OPCVM et au KIID/KID, disponibles gratuitement sur www.ossiam.com, avant de prendre toute décision définitive d'investissement.

Ossia IRL ICAV (« ICAV ») est un fonds à compartiments multiples constitué en tant que société d'investissement à capital variable de droit irlandais avec une responsabilité séparée entre les compartiments et agréé par la Banque centrale d'Irlande sous le numéro C173953. ICAV a nommé Ossia comme société de gestion, responsable de la gestion financière des fonds ainsi que de l'administration et de la distribution d'ICAV. Ossia, 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. L'exactitude, l'exhaustivité ou la pertinence des informations provenant de sources externes ne sont pas garanties, même si elles ont été compilées à partir de sources fiables et réputées. Lorsqu'il est fourni au Royaume-Uni, ce document est distribué à titre informatif uniquement aux clients professionnels ou aux contreparties éligibles aux fins du manuel FCA et ne peut être invoqué ou utilisé par aucune autre personne.

Pour les investisseurs en Suisse : Le représentant et agent payeur du fonds en Suisse est CACEIS Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Succursale de Zurich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zurich.

Le KID/KIID en anglais, ainsi que le prospectus en anglais, sont disponibles gratuitement sur notre site Internet www.ossiam.com.

Investissements ESG – Limites méthodologiques: En utilisant des critères ESG dans la politique d'investissement, l'objectif du fonds concerné serait notamment de mieux gérer le risque de durabilité. Les critères ESG peuvent être générés à l'aide de modèles propres à Ossia, de modèles et de 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 des critères ESG au processus d'investissement peut conduire Ossia à investir dans des titres ou à les exclure pour des raisons non financières, indépendamment des opportunités de marché disponibles. Les données ESG reçues de tiers peuvent être incomplètes, inexactes ou indisponibles de temps à autre. Par conséquent, il existe un risque qu'Ossia évalue incorrectement un titre ou un émetteur, ce qui entraînerait l'inclusion ou l'exclusion directe ou indirecte incorrecte d'un titre dans le portefeuille d'un Fonds.

Risque de durabilité : Le Fonds est soumis aux risques de durabilité tels que définis dans le Règlement 2019/2088 (article 2(22)) par un événement ou une condition de nature environnementale, sociale ou de gouvernance qui, s'il se produit, pourrait avoir un impact négatif significatif réel ou potentiel sur la valeur de l'investissement. De plus amples informations sur le cadre lié à l'intégration de la durabilité sont disponibles sur le site web de la société de gestion.

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

L'instrument financier n'est pas sponsorisé, promu, vendu ou soutenu de quelque autre manière par Solactive AG et Solactive AG n'offre aucune garantie ou assurance expresse ou implicite concernant les résultats de l'utilisation de l'indice et/ou de la marque de l'indice ou du prix de l'indice. à tout moment ou à tout autre égard. L'indice est calculé et publié par Solactive AG. Solactive AG fait de son mieux pour garantir que l'indice est calculé correctement. Indépendamment de ses obligations envers l'émetteur, Solactive AG n'a aucune obligation de signaler les erreurs contenues dans l'indice à des tiers, y compris, mais sans s'y limiter, les investisseurs et/ou les intermédiaires financiers de l'instrument financier. Ni la publication de l'indice par Solactive AG ni la licence de l'indice ou de la marque de l'indice aux fins d'une utilisation en relation avec l'instrument financier ne constituent une recommandation de Solactive AG d'investir du capital dans ledit instrument financier et ne représentent en aucun cas une assurance. ou l'opinion de Solactive AG concernant tout investissement dans cet instrument financier.

L'accès aux produits et services décrits dans ce document peut être soumis à des restrictions à l'égard de certaines personnes ou dans certains pays. Aucun des produits ou services présentés ici ne sera fourni par Ossia à toute personne non légalement autorisée. Il en est de même pour les pays pour lesquels Ossia n'a pas déposé de demande d'autorisation de mise sur le marché.

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