

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 ESG MINIMUM VARIANCE NR Part 1C (EUR) ISIN : FR0013128543

Société de gestion : Ossiam, société du groupe Natixis

### Objectifs et politique d'investissement

#### Objectif d'investissement

Le Fonds OSSIAM US ESG MINIMUM VARIANCE NR (« le Fonds ») vise à répliquer à la hausse comme à la baisse, avant les frais et dépenses qui lui sont appliqués, la performance de l'indice US ESG MINIMUM VARIANCE NR (l'«Indice»), mesurée par son cours de clôture.

L'Indice est un indice de capitalisation (dividendes nets réinvestis) calculé et publié par Solactive (le «Fournisseur d'Indice»). Il est exprimé en dollar américain (USD).

L'Indice reflète la performance d'un échantillon dynamique d'actions satisfaisant des critères ESG (l'Environnement, le Social, et la 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 des États-Unis. Le filtre ESG appliqué est composé d'un processus de sélection des actions les mieux classées selon des critères ESG retenus par le Fournisseur d'Indice et d'un processus d'élimination des actions des sociétés considérées comme non conformes (suite à des problèmes éthiques ou à de la 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 (le « Fournisseur ESG »).

Les critères suivants par exemple sont retenus pour le calcul de la notation ESG globale :

- Critère Environnement : certification du système de management environnemental (SME), gestion des produits en fin de vie,...
- Critère Social : politique de lutte contre la discrimination, suivi des fournisseurs en matière social,...
- Critère Gouvernance : indépendance du conseil d'administration, mise en place d'une politique anti-corruption, mise en place d'une politique concernant les lanceurs d'alerte,...

La méthodologie utilisée n'empêche pas que soient sélectionnées des sociétés mal notées sur certains critères ESG.

Les composants de l'Indice sont pondérés en fonction d'un processus d'optimisation mis en œuvre par le Fournisseur d'Indice. 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 « Indicateur de référence » dans le Prospectus.

Dans des conditions normales de marché, l'écart de suivi mesuré sur une période d'un an est anticipé à 0,50%.

#### Politique d'investissement

Afin de réaliser son objectif d'investissement, le FCP a principalement recours à la réplique physique en investissant dans la totalité ou une partie des actions incluses dans l'Indice.

Le FCP peut également faire de la réplique synthétique en investissant dans des swaps afin de suivre la performance de l'Indice. Dans cette optique, le FCP investit dans un portefeuille d'actifs dont la performance est échangée contre celle de l'Indice, d'un indice associé ou d'un portefeuille de ses composants, par l'intermédiaire d'un contrat de swap conclu avec une contrepartie de swap.

Cette méthode induit un risque de contrepartie, tel que décrit dans le Profil de risque et de rendement ci-dessous. En conséquence, la valeur liquidative par part du FCP augmente (ou diminue) en fonction des variations de l'Indice. La contrepartie de swap doit être un établissement financier de premier ordre spécialisé dans ce type d'opération. Le FCP peut conclure de multiples contrats de swap, auprès de contreparties ayant les mêmes caractéristiques susmentionnées.

Un changement de méthode de réplique peut notamment intervenir dans l'un des cas suivants :

- le nombre de contreparties de swap éligibles est trop restreint,
- la gestion du fonds est impactée négativement par des coûts ou des contraintes opérationnelles trop fortes liées à la méthode de réplique,
- la méthode de réplique courante a démontré un faible appétit voire des réticences chez les investisseurs.

En outre, à titre accessoire, le Fonds peut utiliser d'autres instruments dérivés à des fins d'ajustement de l'exposition aux actions et de couverture du risque de change. La Devise de référence du Fonds est le dollar américain. La devise de la part est l'Euro (EUR).

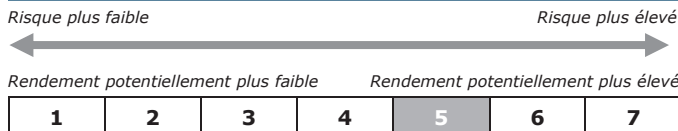
**Classification:** Actions internationales

**Rachat:** Les demandes de rachat de parts sont reçues tous les jours de calcul de la valeur liquidative au plus tard à 16h15 et exécutées quotidiennement. Veuillez lire le Prospectus pour de plus amples renseignements sur le processus de souscription et de rachat.

**Revenus :** La part capitalise ses revenus.

**Période d'investissement recommandée :** 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



Le Fonds se classe dans la 5<sup>e</sup> 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.

Par ailleurs, la catégorie de part du Fonds n'est pas couverte en change et est libellée dans une devise autre que celle de l'Indice. La valeur liquidative de la part est affectée par les fluctuations du taux de change en vigueur entre la devise de la part et la devise de l'Indice, ce qui peut décupler la volatilité au niveau de la part. Ce risque de change est pris en compte dans l'indicateur ci-dessus.

#### Risques importants non pris en compte dans cet indicateur:

##### Risque de liquidité

Pour faire face aux ordres de souscriptions et de rachats, le Fonds doit ajuster son exposition à l'Indice. Si les marchés liés à cette exposition se trouvent limités, fermés ou sujets à d'importants écarts de prix achat/vente, la liquidité du Fonds pourra être affectée et le Fonds pourra subir une perte.

##### Risque de contrepartie

Si le Fonds effectue 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.

##### Risque lié à l'utilisation des instruments dérivés

Si le Fonds conclut des contrats sur instruments dérivés. Le Fonds sera exposé au risque de contrepartie résultant de l'utilisation d'instruments dérivés conclus avec un établissement de crédit. La défaillance d'une contrepartie pourra entraîner une baisse de la Valeur Liquidative du Fonds.

Veuillez lire le Prospectus pour de renseignement sur les risques encourus.

## 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 parts. Ces frais réduisent la croissance potentielle des investissements.

### Frais de la part 1C (EUR)

#### Frais ponctuels facturés avant ou après l'investissement

|                        |                                                                                                                                                 |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Frais d'entrée</b>  | Commission de souscription non acquise à l'OPCVM : 3,00% maximum<br>Commission de souscription acquise à l'OPCVM : 1,00% <sup>(1)</sup> maximum |
| <b>Frais de sortie</b> | Commission de rachat non acquise à l'OPCVM : 3,00% maximum<br>Commission de rachat acquise à l'OPCVM : 1,00% <sup>(1)</sup> maximum             |

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

#### Frais prélevés par le Fonds dans certaines circonstances

**Commission de performance :** Néant

Les frais d'entrée et de sortie indiqués sont des chiffres maximum. Dans certains cas, l'investisseur peut payer moins. Pour en savoir plus, consultez votre conseiller financier.

Concernant les frais courants, le chiffre communiqué se fonde sur les frais de l'exercice clos en décembre 2016. 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 le fonds lors de l'achat ou de la vente de parts d'un autre organisme de placement collectif.

**Pour plus de renseignement concernant les frais, veuillez-vous référer au chapitre « Frais et Commissions » du prospectus du Fonds, qui est disponible à l'adresse [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com).**

<sup>(1)</sup> Dans la limite de ce taux maximum et pour refléter les coûts d'ajustement du portefeuille, la société de gestion applique un barème de commission de souscription ou rachat acquise à l'OPCVM dégressif en fonction du montant de chaque ordre. Ce barème est publié sur le site de la société de gestion [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com) et révisable en fonction des coûts d'exécution négociés avec les contreparties.

## Performances passées

**Il existe trop peu de données pour fournir aux investisseurs de ce Fonds des indications utiles sur les performances passées.**

Les performances passées ne constituent pas un indicateur fiable des performances futures.

Date de création du Fonds : 14 avril 2016

Devise de la part: Euro

## Informations pratiques

Dépositaire: CACEIS BANK France

Le prospectus, les rapports annuels et les derniers documents périodiques, ainsi que toutes autres informations pratiques sont disponibles auprès de la société de gestion sur simple demande écrite à :

OSSIAM, 80 Avenue de la Grande Armée, 75017 Paris ou à l'adresse électronique suivante : [paris@ossiam.com](mailto:paris@ossiam.com)

La valeur liquidative est disponible auprès de la société de gestion à l'adresse électronique mentionnée ci-dessus et sur son site internet [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com)

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](http://www.ossiam.com). Un exemplaire papier gratuit est disponible sur simple demande.

**Fiscalité :** La législation fiscale applicable dans l'Etat membre où le Fonds est domicilié peut affecter les investisseurs. Il est conseillé à l'investisseur de se renseigner à ce sujet auprès de son conseiller fiscal.

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 et OSSIAM sont agréés en France et réglementés par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF).

Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 17 février 2017