

Au 31.03.2023

OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIPTION DE LA STRATÉGIE

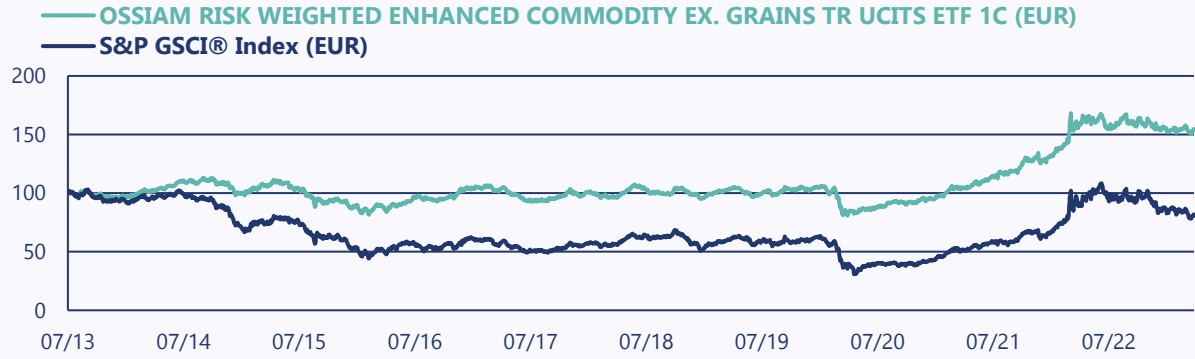
Le fonds Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains TR a pour objectif de répliquer la performance de l'indice Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index Total Return USD calculé et publié par Standard & Poor's.

La stratégie est une approche systématique « long-only » qui vise à offrir une exposition aux matières premières avec une volatilité réduite par rapport à l'univers d'investissement. Contrairement aux indices standards fortement concentrés et exposés au risque de contango, la stratégie Risk Weighted Enhanced Commodity combine une allocation des risques efficiente ainsi que des techniques d'optimisation des « rolls » des contrats futures afin d'en limiter les effets négatifs.

Avantages:

- Exposition à l'ensemble des matières premières (à l'exception des céréales)
- Réduction du risque
- Diversification et optimisation du roll

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	-0,74	-0,40	-0,63	23,28	9,85	4,58
Indice	-0,67	-0,17	0,17	24,08	10,49	5,20
Univers d'Investissement	-3,44	-6,62	-7,87	30,96	7,55	-2,04

Données calculées par Ossiam au 31.03.2023. Source: Ossiam, Standard & Poor's.

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité Ann. %	Apha Ann. %	Beta	Tracking Error %	Ratio de Sharpe	Perte Max. %
Fonds	12,34	5,48	0,44	0,04	0,39	-28,43
Indice	12,34	6,09	0,44	---	0,44	-27,00
Univers d'Investissement	23,43	---	---	---	-0,08	-70,16

Données calculées par Ossiam au 31.03.2023. Source: Ossiam, Standard & Poor's.

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 sont pas un indicateur fiable des performances futures.

Risques spécifiques: Veuillez noter que le fonds est soumis à des risques spécifiques tels que le risque indiciel, le risque lié aux instruments dérivés et aux contreparties, le risque lié aux matières premières 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. Cette classe en EUR n'est pas couverte contre le risque de change.

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'INDICE

Nom	Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR (USD)
Univers d'investissement	S&P GSCI® Index (USD)
Ticker Bloomberg	OCMDRWT Index
Date de lancement	25.02.2013
Classe d'actifs	Matières Premières
Fréquence de rebalancement	Mensuelle

DONNÉES DU FONDS

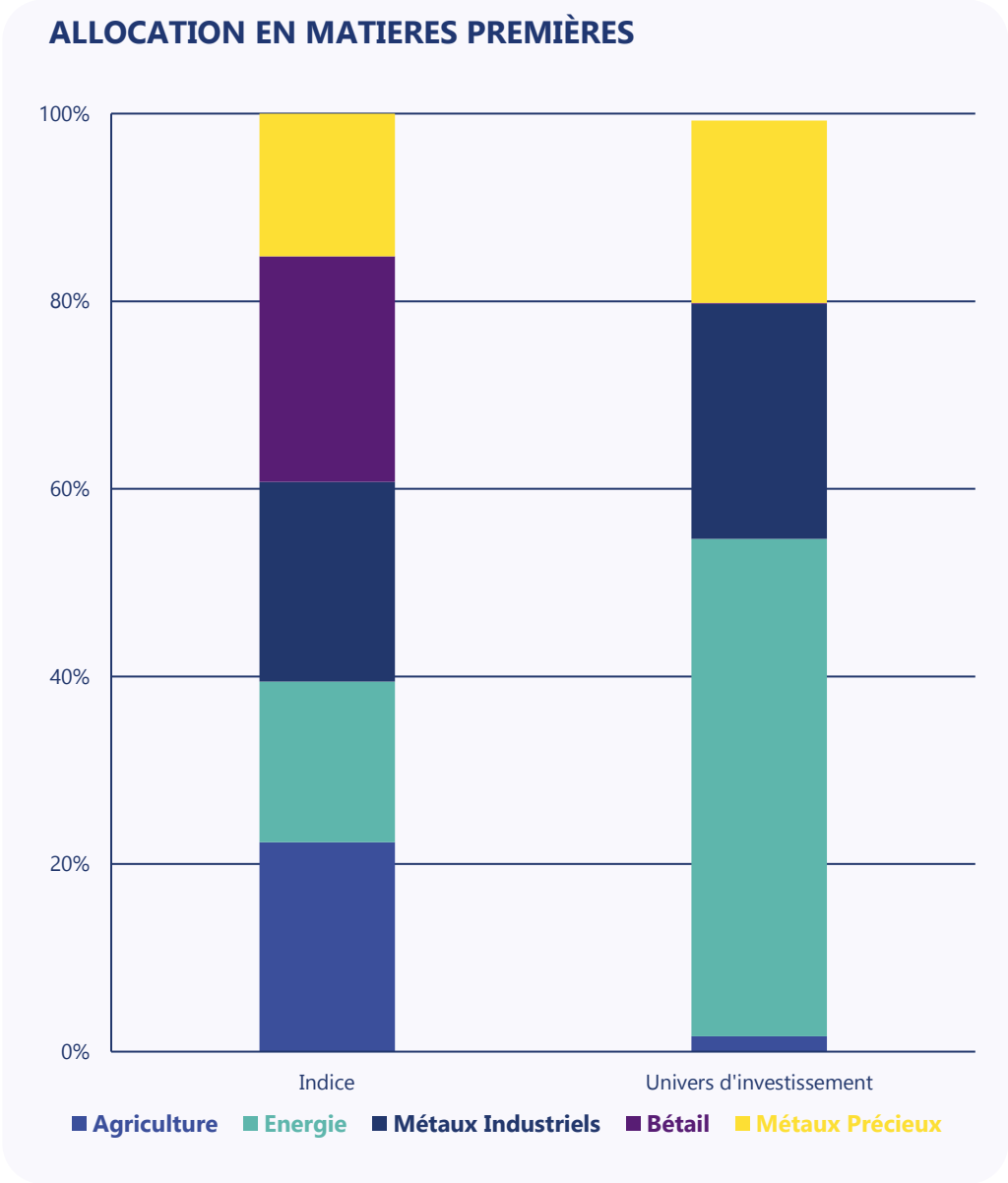
Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Structure juridique	Compartiment de l'Ossiam Lux SICAV
UCITS	Oui
Classification SFDR	Article 6
PEA	Non
Dividendes	Réinvestis
Encours total du fonds	USD 5 654 338
Encours total de la part	EUR 2 987 238
Valeur liquidative	EUR 109.223
Nombre de parts	27 350
Devise du fonds	USD
Devise de la part	EUR
ISIN	LU0876440578
Date de lancement	05.07.2013
Méthode de réplication	Synthétique
TER (frais/an)	0.45%

INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

Heure limite de réception des ordres (marché primaire ¹)	16h00 heure du Luxembourg
Investissement minimum (marché secondaire)	1 Action

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

XETRA en EUR	OSXC GY
Euronext Paris en EUR	CRWE FP
SIX Swiss Exchange en EUR	CRWE SW
Borsa Italiana en EUR	CRWE IM



Données calculées par Ossiam au 31.03.2023. Source: Ossiam, Standard & Poor’s.

TOP 10 DES VALEURS

	Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR
S&P GSCI LIVE CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	11.18%
S&P GSCI GOLD DYNAMIC ROLL INDEX ER	9.97%
S&P GSCI FEEDER CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	8.20%
S&P GSCI SUGAR DYNAMIC ROLL INDEX ER	7.47%
S&P GSCI COCOA DYNAMIC ROLL INDEX ER	7.44%
S&P GSCI COPPER DYNAMIC ROLL INDEX ER	5.84%
SILVER DYNAMIC ER	5.25%
S&P GSCI ALUMINUM DYNAMIC ROLL INDEX ER	4.85%
S&P GSCI LEAD DYNAMIC ROLL INDEX ER	4.79%
S&P GSCI LEAN HOGS DYNAMIC ROLL INDEX ER	4.67%

	S&P GSCI® Index
S&P GSCI CRUDE OIL INDEX TR	31.42%
S&P GSCI COPPER INDEX TR	18.68%
S&P GSCI GOLD INDEX TR	17.02%
S&P GSCI BRENT CRUDE INDEX TR	15.17%
S&P GSCI GASOIL INDEX TR	4.26%
S&P GSCI ALLUMINUM T RET	4.19%
S&P GSCI SILVER INDEX TR	2.41%
S&P GSCI NATURAL GAS INDEX TR	2.00%
S&P GSCI NICKEL INDEX TR	1.17%
S&P GSCI ZINC INDEX TR	1.02%

Données calculées par Ossiam au 31.03.2023. Source: Ossiam, Standard & Poor’s.

CONTACT / INFO

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

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 RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR (compartiment de la SICAV) est autorisé à la commercialisation en France depuis le 17/07/2013. Pour les investisseurs basés en Suisse : le représentant des fonds et agent payeur en Suisse est RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Succursale de Zurich, Bleicherweg 7, 8027 Zurich.

Le KID en langue française, ainsi que le prospectus en langue française, sont disponibles gratuitement sur www.ossiam.com

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 le site www.ossiam.com

L'indice OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR n'est en aucun cas financé, approuvé, vendu ou promu par Standard & Poor's Financial Services LLC (« S&P »), par ses filiales ou par ses concédants. S&P, ses filiales et ses concédants ne font aucune déclaration et n'émettent aucune garantie, qu'elle soit expresse ou implicite, vis-à-vis des détenteurs de parts de OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR ou de toute autre personne quant au bien-fondé d'un investissement en général en valeurs mobilières ou en particulier dans l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR ou quant à la capacité de l'indice Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index Total Return USD (« l'Indice ») à suivre les performances générales du marché des actions. S&P et ses concédants tiers n'entretiennent avec Ossiam qu'une relation d'octroi de licences pour certaines marques, marques de services et marques déposées par S&P et/ou ses concédants tiers et de prise en charge des calculs et des services de maintenance liés à l'Indice. S&P, ses filiales et ses concédants tiers ne peuvent être tenus pour responsables de, ni n'ont participé à la détermination des prix et du montant de l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR S&P à la planification de l'émission ou de la vente de l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR ou à la détermination ou au calcul de l'équation par laquelle l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR est converti en liquidités. S&P n'a aucune obligation ni responsabilité quant à la gestion, à la mise sur le marché ou au négoce de l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR. S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE GARANTISSENT EN AUCUN CAS LA PERTINENCE, L'EXACTITUDE, LA VALIDITÉ OU L'EXHAUSTIVITÉ NI DE L'INDICE, NI DES DONNÉES QUI LE COMPOSENT, NI DES COMMUNICATIONS, DONT ENTRE AUTRES, LES COMMUNICATIONS VERBALES ET ÉCRITES (Y COMPRIS LES COMMUNICATIONS ÉLECTRONIQUES) QUI S'Y RAPPORTENT. S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE PEUVENT ÊTRE TENUS POUR RESPONSABLES DES DOMMAGES OU PERTES SURVENUS SUITE À DES ERREURS, OMISSIONS OU RETARDS LIÉS À L'INDICE, AUX DONNÉES ET AUX COMMUNICATIONS SUSMENTIONNÉS. S&P NE FORMULE AUCUNE GARANTIE, QU'ELLE SOIT EXPRESSE OU IMPLICITE, ET DÉNIE EXPRESSÉMENT TOUTE GARANTIE QUANT À LA QUALITÉ MARCHANDE OU À LA PERTINENCE POUR UN BUT OU UN USAGE PRÉCIS DE SES MARQUES COMMERCIALES, DE L'INDICE OU DE TOUTE DONNÉE QUI LE COMPOSE. SANS LIMITATION DE CE QUI PRÉCÈDE, S&P, SES FILIALES ET SES CONCÉDANTS TIERS NE PEUVENT EN AUCUN CAS ÊTRE TENUS POUR RESPONSABLES D'UN QUELCONQUE DOMMAGE INDIRECT, SPÉCIAL, MINEUR, PUNITIF OU IMPORTANT, DONT, SANS S'Y LIMITER, LES MANQUES À GAGNER, PERTES D'EXPLOITATION, PERTES DE TEMPS OU DÉGRADATIONS D'ACTIFS INCORPORELS, MÊME DANS LES CAS OÙ ILS ONT ÉTÉ INFORMÉS DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES, QUE CE SOIT EN VERTU D'UNE RESPONSABILITÉ CONTRACTUELLE, DÉLICTELLE, CIVILE OU AUTRE.

Standard & Poor's® and S&P® ® sont des marques déposées de Standard & Poor's Financial Services LLC. « Calculated by S&P Custom Indices » et sa marque stylisée connexe sont des marques de service de Standard & Poor's Financial Services LLC pour lesquelles Ossiam a obtenu une licence d'utilisation.

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.

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



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.

