

Au 30.04.2024

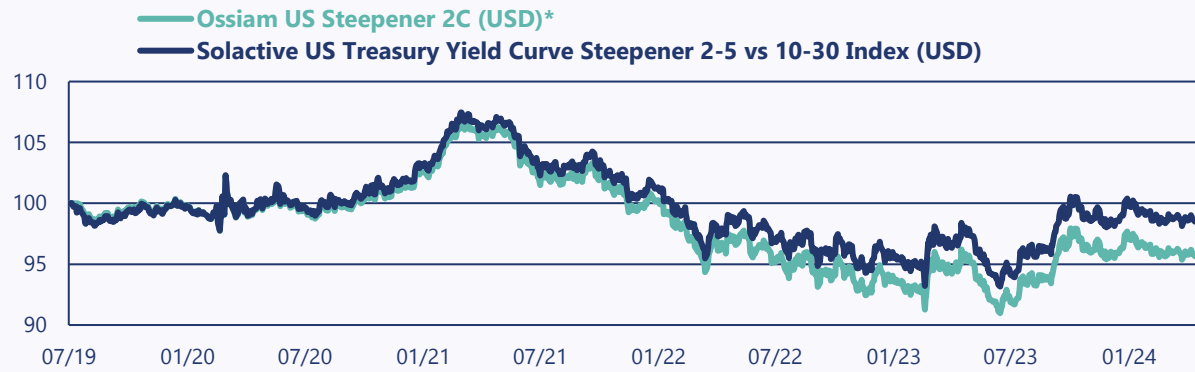
OSSIAM US STEEPENER 2C (USD)

DESCRIPTION DE LA STRATEGIE

La stratégie Ossiam US Steepener vise à répliquer la performance de l'indice Solactive US Treasury Yield Curve Steepener 2-5 vs 10-30. L'indice est investi dans des contrats à terme sur des bons du Trésor américain et est conçu pour bénéficier d'une éventuelle augmentation de la pente des taux d'intérêt américains, ou courbe des taux, tout en limitant la sensibilité à un mouvement parallèle de la courbe des taux de rendement. La pente des taux d'intérêt américains correspond à l'écart entre les taux long terme (10 et 30 ans) et les taux court terme (2 et 5 ans). Pour bénéficier d'une augmentation de la pente, l'indice achète des contrats à terme les taux courts et vend des contrats à terme sur les taux longs. Pour limiter la sensibilité du portefeuille à un mouvement parallèle de la courbe des taux, la patte «acheteuse» sur les contrats court terme et la patte «vendeuse» sur les contrats long terme sont ajustées lors de chaque rebalancement pour obtenir un portefeuille de duration neutre.

- La stratégie:
- Fournit une exposition neutre en duration à la pente des taux d'intérêt américains ;
 - Vise à bénéficier d'une éventuelle augmentation de la pente des taux d'intérêt américains.

PERFORMANCE (NETTE) DU FONDS DEPUIS LE LANCEMENT



Données calculées par Ossiam au 30.04.2024. Source: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

PERFORMANCES NETTES

	Perf. 1 mois %	Perf. depuis Jan. %	Perf. 1 an %	Perf. 3 ans ann. %	Perf. 5 ans ann. %	Ann. depuis création %
Fonds	0.16	-0.28	1.36	-3.20	---	-0.85
Indice	0.21	-0.09	2.05	-2.59	---	-0.32
Univers d'investissement	0.49	1.84	5.53	2.92	2.11	2.09

Données calculées par Ossiam au 30.04.2024. Source: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

PARAMÈTRES DE RISQUES DEPUIS LE LANCEMENT

	Volatilité Ann. %	Apha Ann. %	Beta	Tracking Error 1 an %	Ratio de Sharpe	Perte Max. %
Fonds	5.15	---	---	0.10	-0.58	-14.53
Indice	5.16	---	---	---	-0.47	-13.32
Univers d'investissement	0.19	---	---	---	---	0.00

Données calculées par Ossiam au 30.04.2024. Source: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

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: 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 de crédit, le risque lié à l'effet de levier, le risque de concentration géographique, le risque lié à la concentration du portefeuille 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. *L'absence de performance au niveau du fonds en juillet 2019 est liée à l'arrivée tardive de l'investissement réel par rapport à sa date de lancement. 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 2 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	Solactive US Treasury Yield Curve Steepener 2-5 vs 10-30 Index (USD)
Univers d'investissement	Fed Funds (USD)
Ticker Bloomberg	SOUSTFTT Index
Date de lancement	09.05.2019
Classe d'actifs	Fixed Income
Fréquence de rebalancement	Trimestrielle

DONNÉES DU FONDS

Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Structure juridique	Compartiment d'Ossiam Lux SICAV
UCITS	Oui
Classification SFDR	Article 6
PEA	Non
Encours total du fonds	USD 184 398 065
Encours total de la part	USD 72 590 615
Valeur liquidative	USD 123.870
Nombre de parts	586 023
Devise du fonds	USD
Devise de la part	USD
ISIN	LU1991353761
Date de lancement	19.07.2019
Méthode de réplcation	Synthétique
TER (frais/an)	0.30%

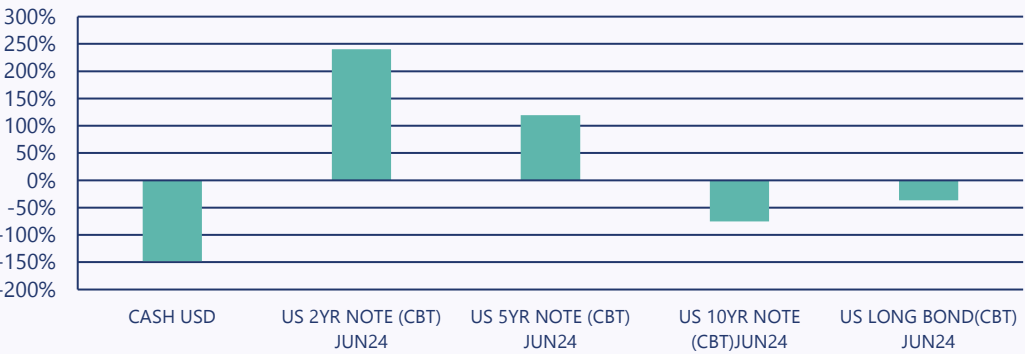
INFORMATION SUR LES TRANSACTIONS

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

BLOOMBERG en USD	STEEPNE LX
WKN en USD	A2PKUL

COMPOSITION DE L'INDICE*



*Les pondérations négatives reflètent une position vendeuse de l'indice sur ces actifs.
Données calculées par Ossiam au 30.04.2024. Source: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

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

DIFFÉRENCE HISTORIQUE ENTRE LES TAUX LONG¹ ET LES TAUX COURTS² AMÉRICAINS



¹ moyenne entre les taux américains 10 ans et 30 ans. ² moyenne entre les taux américains 2 ans et 5 ans.
Données calculées par Ossiam au 30.04.2024. Source: Ossiam, Refinitiv, Solactive.

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.

Ossiam Lux (la SICAV) composée de plusieurs compartiments distincts (chacun constituant un « Fonds »). La SICAV a reçu le visa de la Commission de Surveillance du Secteur Financier du Grand-Duché de Luxembourg. La SICAV a désigné Ossiam comme société de gestion chargée de la gestion financière des fonds, de l'administration et de la distribution de la SICAV. La Société de Gestion a nommé State Street Bank International GmbH, succursale de Luxembourg, en qualité d'Agent Administrateur, Agent Payeur, Agent Domiciliataire 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. 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.

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 Ossiam à toute personne non légalement autorisée. Il en est de même pour les pays pour lesquels Ossiam 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

