COMMUNICATION MARKETING

STRICTEMENT RÉSERVÉ AUX INVESTISSEURS PROFESSIONNELS OU NON PROFESSIONNELS INVESTIS DANS LE FONDS.

OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR - UCITS ETF 1C (EUR)

Description de la stratégie

Le fonds Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR vise à répliquer la performance de l'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR calculé et publié par Bloomberg Index Services Limited. Le processus d'investissement du fonds est systématique de type « value » fondé sur les travaux du Professeur Robert Shiller. La stratégie offre une exposition aux actions américaines grâce à une sélection des secteurs faite à partir du Cyclically Adjusted Price-to-Earnings (CAPE®) ratio qui permet de sélectionner les secteurs potentiellement sous-évalués. Cette stratégie qui vise à offrir une exposition aux grandes capitalisations avec un biais « value », s'adresse à des investisseurs de long terme.

Avantages:

- Exposition aux actions américaines à travers une sélection de secteurs basée sur le ratio CAPE®
- Un outil de valorisation fondé sur les travaux du professeur Shiller
- Un processus d'investissement visant à identifier les secteurs potentiellement sous-évalués sur le long terme

Performance (nette) du produit depuis le lancement du fonds



Données calculées par Ossiam au 30.10.2026. Source: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

Performance nette (%)

	Perf. mois	Perf. YTD	Perf. 1 an	Perf. 3 ans ann.	Perf. 5 ans ann.	ann. depuis lancement
Fonds	6.94	10.99	12.03	13.33	9.09	12.97
Indice	7.01	11.69	12.85	14.12	9.79	13.62
Univers d'investissement	0.85	17.26	15.51	20.71	12.38	13.40

Données calculées par Ossiam au 30.10.2026. Source: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

Paramètres de risque depuis le lancement du fonds

	Volatilité ann. %	Alpha ann. %	Bêta	Tracking error	Ratio de Sharpe	Perte max. %
Fonds	18.77	0.41	0.94	0.05	0.65	-34.48
Indice	18.78	1.06	0.94	---	0.69	-34.50
Univers d'investissement	19.03	---	---	---	0.67	-33.63

Données calculées par Ossiam au 30.10.2026. Source: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

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 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. 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

RISQUE PLUS FAIBLE — RISQUE PLUS ÉLEVÉ

1	2	3	**4**	5	6	7

Nous avons classé le Fonds dans la classe de risque 4 qui est une classe de risque entre moyenne et élevée. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau entre moyen et élevé et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est probable que notre capacité à vous payer en soit affectée. Le risque de liquidité du marché peut accentuer la variation des performances du produit. Outre les risques inclus dans l'indicateur de risque, d'autres risques peuvent influer sur la performance du Fonds. Veuillez vous reporter au prospectus du Fonds.

Caractéristique de l'indice

Nom	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index EUR
Univers d'investissement	S&P 500 Index NTR EUR
Ticker Bloomberg	BXIICUSE Index
Ticker de l'univers	SPTRNE Index
Classe d'actifs	Actions

Données du fonds

Dépositaire	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Forme juridique	Compartiment d'Ossiam Lux SICAV
UCITS	Oui
Classification SFDR	Article 6
Dividendes	Réinvestis
Type	ETF passif
Encours total du fonds	USD 2,423,671,799
Encours de la part	EUR 568,828,959
Valeur liquidative	EUR 1,538.444
Nombre de parts	369,743
Devise de référence du fonds	USD
Devise de la part	EUR
ISIN	LU1079841273
Date de lancement	22/06/2015
Méthode de réplication	Synthétique
Frais courants	0.65%
PEA	Non

Information sur les transactions

Heure limite sur le marché primaire*	16h00 (heure du Luxembourg)
Investissement minimum sur le marché secondaire	1 action
Borsa Italiana	CAPU IM
Euronext Paris	CAPU FP
SIX Swiss Exchange	CAPU SE
Xetra	USCP GY

Uniquement pour les Participants Autorisés et les investisseurs agréés

COMMUNICATION MARKETING

STRICTEMENT RÉSERVÉ AUX INVESTISSEURS PROFESSIONNELS OU NON PROFESSIONNELS INVESTIS DANS LE FONDS.

TOP 10

	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index EUR	S&P 500 Index NTR EUR
Meta Platforms Inc	4.79%	2.08%
Alphabet Inc	4.35%	4.54%
NextEra Energy Inc	3.33%	0.27%
Linde PLC	3.33%	0.36%
Walmart Inc	2.97%	0.84%
Costco Wholesale Corp	2.42%	0.69%
Southern Co/The	2.06%	0.17%
Procter & Gamble Co/The	2.02%	0.58%
Coca-Cola Co/The	1.96%	0.56%
Duke Energy Corp	1.89%	0.15%

Données calculées par Ossiam au 30.10.2026. Source: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

Allocation sectorielle

	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index EUR	S&P 500 Index NTR EUR
Consumer Staples	26.6%	5.0%
Utilities	26.0%	2.1%
Materials	25.8%	1.8%
Communication Services	20.8%	8.3%
Information Technology	0.8%	37.5%
Financials	0.0%	12.2%
Health Care	0.0%	10.3%
Consumer Discretionary	0.0%	9.0%
Industrials	0.0%	8.1%
Energy	0.0%	3.9%
Real Estate	0.0%	1.8%

Données calculées par Ossiam au 30.10.2026. Source: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

Avertissement

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.

www.ossiam.com
info@ossiam.com
+33 1 84 79 42 70
36 rue Brunel, 75017 Paris - France

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.

Risque de durabilité : Le Fonds est soumis à des risques de durabilité tels que définis dans le Règlement 2019/2088 (article 2(22)) par un événement ou une condition environnementale, sociale ou de gouvernance qui, s'il se produisait, pourrait entraîner un impact négatif matériel réel ou potentiel sur la valeur de l'investissement. De plus amples informations sur le cadre lié à l'intégration du développement durable peuvent être trouvées sur le site Internet de la Société de Gestion.

La politique de vote par procuration et d'engagement est disponible sur notre site Internet www.ossiam.com. Veuillez vous référer au prospectus du fonds et au site Internet du gestionnaire d'investissement pour plus d'informations sur la méthodologie d'évaluation ESG du fonds.
Barclays Bank PLC et ses sociétés affiliées (« Barclays ») ne sont pas l'émetteur ou le producteur de l'Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR, de l'Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR ou de l'Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF (collectivement, les « Produits ») et Barclays n'ont aucune responsabilité, obligation ou devoir envers les investisseurs dans les Produits, sauf dans le cadre de leur distribution conformément à un accord avec Ossiam. L'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR et l'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR (collectivement, les « Indices ») sont des marques déposées détenues ou sous licence d'utilisation par Barclays Bank PLC et sont autorisées à être utilisées par Ossiam Lux et/ou Ossiam IRL en tant que « Émetteur(s) » des Produits. Alors qu'Ossiam Lux et/ou Ossiam IRL, en tant qu'émetteurs des produits, et pour leur propre compte, exécutent des transactions avec Barclays dans ou liées aux indices en relation avec les produits, les investisseurs acquièrent les produits auprès d'Ossiam Lux et/ou Ossiam IRL. ou Ossiam IRL et les investisseurs n'acquièrent aucun intérêt dans les Indices et n'entrent dans aucune relation de quelque nature que ce soit avec Barclays lors d'un investissement dans les Produits. Les Produits ne sont ni sponsorisés ni approuvés par Barclays et Barclays ne fait aucune déclaration concernant l'adéquation ou l'opportunité des Produits ou l'utilisation ou le référencement des Indices (y compris, sans limitation, tout processus de sélection ou de filtrage appliqué par Ossiam en relation avec les Indices (ou tout composant ou constituant de celui-ci) en relation avec tout produit lié à l'ESG qui est activement géré par Ossiam) ou toute donnée qui y est incluse, sauf dans le cadre de leur distribution conformément à un accord avec Ossiam. Barclays ne sera en aucun cas responsable envers l'émetteur, les investisseurs ou d'autres tiers en ce qui concerne l'utilisation ou l'exactitude des indices ou de toute donnée qui y est incluse. En ce qui concerne les produits liés à l'ESG, ni Barclays ni RSBB-I LLC n'ont fourni de contribution aux méthodologies ou notations ESG ou à faible émission de carbone appliquées par Ossiam en relation avec ces produits, et ni Barclays ni RSBB-I LLC ne font donc de déclaration. en ce qui concerne l'exactitude, la validité ou l'adéquation de ces méthodologies ou notations ESG et bas carbone. Le Produit ne constitue pas des investissements qui financent un projet lié à l'ESG, mais offre uniquement une exposition à certains composants de l'indice sous-jacent sur la base de la méthodologie de filtrage ESG et des notations appliquées par Ossiam. La composition des actifs sous-jacents référencés par le Produit (y compris les composants de l'Indice) peut varier dans le temps. Il est important de noter que la notation ESG globale est influencée par un certain nombre de facteurs et, par conséquent, par exemple, une note plus élevée pour les facteurs environnementaux peut compenser une note plus faible pour les facteurs sociaux, ou vice versa. Barclays note qu'il n'existe actuellement aucun cadre ou définition (juridique, réglementaire ou autre) mondialement accepté, ni consensus de marché quant à ce qui constitue un « ESG » (environnemental, social ou de gouvernance), « vert », « durable », « respectueux du climat » ou un produit labellisé de manière équivalente, ou sur les attributs précis requis pour qu'un investissement, un produit ou un actif particulier soit défini comme « ESG », « vert », « durable », « respectueux du climat » ou autre. autre label équivalent et aucune garantie ne peut être donnée qu'une définition aussi claire ou un consensus aussi clair se développera au fil du temps. Barclays ne fait aucune déclaration ni assurance quant à la performance ESG de l'investissement, du produit, de l'indice ou de l'actif, à son alignement ou à sa conformité à tout régime réglementaire ou à toute évaluation de sa filiale ou de tiers, ni à toute performance ESG future, à son alignement ou à sa conformité à tout régime réglementaire ou avec toute évaluation affiliée ou tierce. Barclays ne fait aucune déclaration et ne garantit pas non plus que l'investissement, le produit ou l'actif répondra à tout ou partie des objectifs ou attentes des investisseurs ou des utilisateurs concernant tout objectif pertinent « ESG », « vert », « durable » ou autres objectifs étiquetés de manière équivalente, ou que tout aucun impact environnemental, social et/ou autre ne se produira, il ne peut donc y avoir aucune garantie quant à la viabilité de l'investissement, de l'indice, du produit ou de l'actif à des fins ESG. Toute question quant à la viabilité de l'investissement, du produit, de l'indice ou de l'actif à des fins ESG peut limiter la liquidité et affecter négativement la valeur marchande de l'investissement, du produit ou de l'actif ou, dans le cas d'indices, de tout investissement, produit ou actif qui utilise de tels indices. Toutes caractéristiques de durabilité, critères d'investissement d'impact ou autres caractéristiques ESG peuvent eux-mêmes limiter la liquidité ou affecter négativement la valeur de marché de l'investissement, du produit ou de l'actif ou, dans le cas d'indices, de tout investissement, produit ou actif qui utilise de tels indices. Barclays n'a procédé à aucune évaluation de l'investissement, du produit, de l'indice ou de l'actif pour vérifier sa conformité aux fins de classification du Règlement de l'UE sur les divulgations en matière de finance durable, aux fins de classification du Règlement sur la taxonomie de l'UE ou aux régimes de classification équivalents (« Régimes de classification »), ni ne les a autrement pris en compte à ces fins. Il est rappelé aux investisseurs, utilisateurs et autres personnes concernées qu'ils devront procéder à leurs propres évaluations à ces fins et que Barclays n'assume aucune responsabilité à cet égard. Les informations et données contenues ou mentionnées ici ont été fournies par un tiers. Barclays ne garantit pas que les informations ou données ESG de tiers sont exactes ou complètes, ni que Barclays a (elle-même ou via un tiers) pris des mesures pour vérifier de manière indépendante ou autrement ces informations et données. En conséquence, Barclays décline toute responsabilité pour toute perte directe, indirecte ou consécutive résultant de toute action ou inaction entreprise sur la base des informations ou de tout autre contenu contenu dans le présent document ou en relation avec les déterminations prises dans le cadre des régimes de classification par les investisseurs, les utilisateurs et d'autres personnes concernées. Il est rappelé aux investisseurs, utilisateurs et autres personnes concernées que des divergences d'opinion sont possibles. Différentes personnes (y compris des fournisseurs de données tiers, des investisseurs et d'autres institutions financières) peuvent interpréter et appliquer différents critères, notamment en utilisant des méthodologies internes, et parvenir à des conclusions différentes concernant l'investissement, l'indice, le produit ou l'actif. Il est conseillé aux investisseurs, utilisateurs et autres personnes concernées d'obtenir leurs propres conseils financiers, juridiques, réglementaires, fiscaux ou autres si nécessaire afin de prendre leur propre décision d'investissement quant à savoir si l'indice, l'investissement, le produit ou l'actif répond à leurs besoins et de prendre leur propre détermination quant à l'indice, à l'investissement, au produit ou à l'actif et à l'avenir de l'indice, de l'investissement, du produit ou de l'actif, y compris la performance ESG, l'alignement ESG et l'alignement ou la conformité à tout régime réglementaire (y compris, sans s'y limiter, les régimes de classification) . Bloomberg Index Services Limited est l'agent officiel de calcul et de maintenance de l'indice, un indice détenu et administré par Barclays. Bloomberg Index Services Limited ne garantit pas l'actualité, l'exactitude ou l'exhaustivité des calculs de l'indice ou de toute donnée ou information relative à l'indice. Bloomberg Index Services Limited n'offre aucune garantie, expresse ou implicite, quant à l'indice ou aux données ou valeurs s'y rapportant ou aux résultats qui peuvent en être obtenus, et décline expressément toute garantie de qualité marchande et d'adéquation à un usage particulier à l'égard de celui-ci. Dans la mesure permise par la loi, Bloomberg Index Services Limited, ses sociétés affiliées et tous leurs partenaires, employés, sous-traitants, agents, fournisseurs et vendeurs respectifs (collectivement, les « parties protégées ») n'auront aucune responsabilité, éventuelle ou autrement, pour toute blessure ou tout dommage, qu'il soit causé par la négligence d'une partie protégée ou autre, survenant en relation avec le calcul de l'indice ou de toute donnée ou valeur incluse dans celui-ci ou en relation avec celui-ci et ne sera pas responsable de toute perte de bénéfices, pertes, dommages punitifs, accessoires ou consécutifs. Les indices Shiller Barclays ont été développés en partie par RSBB-I, LLC, dont le directeur de recherche est Robert J. Shiller. RSBB-I, LLC n'est pas un conseiller en investissement et ne garantit pas l'exactitude ou l'exhaustivité des indices Shiller Barclays, ni des données ou méthodologies qui y sont incluses ou sur lesquelles ils sont basés. Ni RSBB-I, LLC, ni Robert J. Shiller et son consultant, IndexVestLAB, LLC et ses consultants, ne pourront être tenus responsables des erreurs, omissions ou interruptions, et n'offrent aucune garantie, expresse ou implicite, quant aux performances ou aux résultats. expérimenté par toute partie suite à l'utilisation de toute information incluse dans ce document ou sur laquelle elle est basée, et décline expressément toute garantie de qualité marchande ou d'adéquation à un usage particulier en ce qui concerne celle-ci, et ne sera pas responsable de toute réclamation ou perte de quelque nature que ce soit dans lien avec l'utilisation de ces informations, y compris, mais sans s'y limiter, la perte de profits ou les dommages punitifs ou consécutifs, même si RSBB-I, LLC ou l'une de ces autres parties est informée de cette possibilité. Ni RSBB-I, LLC ni Robert J. Shiller et son consultant, IndexVestLAB, LLC et ses consultants n'ont fourni de contribution aux méthodologies ou notations ESG ou Low Carbon appliquées par Ossiam en relation avec des produits liés à l'ESG, et ne font donc aucune contribution. représentation quant à l'exactitude, la validité ou l'adéquation de ces méthodologies ou notations ESG et Low Carbon. Le Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Inde est calculé par Barclays Bank plc à l'aide des valeurs de niveau indice de fin de journée sous licence MSCI (« Données MSCI »). Les données MSCI sont fournies « EN L'ÉTAT » sans garantie ni responsabilité et aucune copie ou distribution n'est autorisée. MSCI ne fait aucune déclaration concernant l'opportunité d'un investissement ou d'une stratégie et ne parraine, ne promeut, n'émet, ne vend ni ne recommande ni n'approuve aucun investissement ou stratégie, y compris tout produit ou stratégie financier basé sur, suivant ou utilisant de toute autre manière des données MSCI. , modèles, analyses ou autres documents ou informations. 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.
Veuillez lire attentivement le prospectus et le Document d'Information Clé avant d'investir. Si le fonds est enregistré dans votre juridiction, ces documents sont également disponibles gratuitement et dans la langue officielle du pays d'enregistrement sur le site Internet de Natixis Investment Managers (im.natixis.com/intl/intl-fund-documents).
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 par actions simplifiée -SAS 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 International, Luxembourg BRANCH (Numéro d'immatriculation: B283713), 2, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg.
En Belgique : Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers International, Belgian BRANCH (Numéro d'immatriculation: 1006.931.462), Gare Maritime, Rue Picard 7, Bte 100, 1000 Bruxelles, Belgique.
En Suisse : Le présent document est fourni par Natixis Investment Managers, Switzerland Sàrl (Numéro d'immatriculation: CHE-114.271.882), 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 analyses, les opinions et certains des thèmes et processus mentionnées dans le présent document représentent le point de vue de (des) l'auteur(s) référencé(s) à la date indiquée. Celles-ci, ainsi que les valeurs mobilières en portefeuille et les caractéristiques présentées, sont susceptibles de changer et ne sauraient être interprétées comme possédant une quelconque valeur contractuelle. Il n'y a aucune garantie que les développements se produiront comme cela peut être prévu dans ce matériel. Les analyses et opinions exprimées par des tiers externes sont indépendantes et ne reflètent pas nécessairement celles de Natixis Investment Managers. Les chiffres des performances citées ont trait aux années écoulées. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.
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.