



Ossiam fête le premier anniversaire de ses ETF

Paris, le 17 juillet 2012 - Ossiam, la société de gestion spécialiste du smart beta¹ et des ETF de stratégie, filiale de Natixis Global Asset Management, a fêté le premier anniversaire de six de ses ETF cotés sur NYSE Euronext Paris.

Les ETF cotés sur NYSE Euronext Paris qui ont franchi cette étape d'un an sont :

- Ossiam ETF CAC 40® Equal Weight NR
- Ossiam ETF Euro Stoxx 50® Equal Weight NR
- Ossiam ETF STOXX® Europe 600 Equal Weight NR
- Ossiam ETF iSTOXX™ Europe Minimum Variance NR
- Ossiam ETF US Minimum Variance NR (EUR)
- Ossiam ETF US Minimum Variance NR (USD)

Ces fonds sont également cotés à Francfort, Londres, Milan et Zurich.

A cette occasion, **Bruno Poulin, Président d'Ossiam** a déclaré : « *Un an après le lancement de nos premiers ETF de stratégie, je suis heureux de pouvoir dresser un bilan très positif pour Ossiam.*

Tout d'abord, nos solutions smart beta permettent à nos clients d'accéder à des stratégies d'investissement transparentes, aux profils de risques complémentaires et facilement intégrables au sein de stratégies d'allocation globale.

Ensuite, fort de son approche systématique, Ossiam Minimum Variance a atteint son objectif en surperformant largement ses univers d'investissement respectifs, offrant ainsi la possibilité de bâtir des portefeuilles plus diversifiés avec une réduction moyenne de 30% de la volatilité et des drawdowns. Par ailleurs, la performance de nos fonds en termes de « tracking error » est remarquable.*

Enfin, avec la cotation en mars 2012 d'un nouvel ETF de Stratégie « Minimum Variance » portant sur les marchés émergents, le prix « émetteur d'ETF de l'année » décerné en juin par Global Investor / ISF Investment, et notre confiance dans nos perspectives de collecte, Ossiam s'installe durablement dans une dynamique positive ».

¹ Le smart beta fait référence à des stratégies de gestion indicielles tenant compte des caractéristiques individuelles de chacune des valeurs composant l'indice, offrant ainsi une alternative aux indices traditionnels pondérés par la capitalisation boursière.

**Selon des calculs réalisés par Ossiam le 29/06/12, basés sur des données de « backtesting » fournies par STOXX Ltd (pour les données antérieures au 14/06/2011 pour iSTOXX™ Europe Minimum Variance Index NR), Standard & Poor's (pour les données antérieures au 06/06/2011 pour Ossiam US Minimum Variance Index NR). Les résultats issus de la performance des « backtestings » sont purement hypothétiques et ne sont pas représentatifs de la performance des échanges réels réalisés sur la base des actifs des clients, ils sont issus de l'application rétroactive d'un modèle. Ce modèle suppose le réinvestissement des dividendes nets. La performance passée n'est pas un indicateur fiable de la volatilité future.*

Les six fonds reposent sur deux stratégies smart beta : *Equal Weight* (diversification) d'une part et *Minimum Variance* (gestion du risque) d'autre part.

Les **ETF de stratégie Ossiam Minimum Variance** ont été les premiers ETF de stratégie commercialisés en Europe à donner accès à un portefeuille diversifié, où les actions sont sélectionnées et pondérées afin d'atténuer le risque (faible volatilité). Les univers d'investissement pour ces ETF de stratégie sont respectivement le STOXX Europe 600 et le S&P 500.

ETF	Code Isin	Performance 1 an*	Volatilité**
OSSIAM ETF iSTOXX™ EUROPE MINIMUM VARIANCE NR	LU0599612842	+ 6,79% (vs – 3,74% pour le STOXX Europe 600 Index NR)	13,37% (vs 22,93% pour le STOXX Europe 600 Index NR) -
OSSIAM ETF US MINIMUM VARIANCE NR (USD)	LU0599612412	+ 14,09% (vs + 5.81% pour le S&P 500 Index NR)	15,74% (vs 23,34% pour le S&P 500 Index NR)
OSSIAM ETF US MINIMUM VARIANCE NR (EUR)	LU0599612685	+ 29,41% (vs + 20,03% pour le S&P 500 Index NR)	14,55% (vs 19,53% pour le S&P 500 Index NR)

La performance passée n'est pas un indicateur fiable de la volatilité future.

Ossiam a remporté le prix de l'émetteur d'ETF de l'année à l'occasion du Global Investor / ISF Investment Excellence Awards 2012, pour ses ETF de stratégie Minimum Variance.

Les **ETF de stratégie Ossiam Equal Weight** reposent sur des indices de stratégie européens larges et attribuent une pondération identique à l'ensemble des valeurs qui les composent pour éviter les effets de concentration et la sur représentation des plus grosses sociétés. Les ETF de stratégie Equal Weight sont avant tout des outils tactiques, qui s'intègrent dans des stratégies globales d'allocation. Leur performance a été favorable en début d'année avec le rebond des marchés. Par la suite, leur exposition aux valeurs petites et moyennes a pesé sur la performance annuelle des fonds.

ETF	Code Isin	Performance 1 an*	Volatilité**
OSSIAM ETF CAC 40® EQUAL WEIGHT NR	LU0599612768	- 20,46% (vs - 15,82% pour le CAC 40 index NR)	33,27% (vs 29,86% pour le CAC 40 index NR)
OSSIAM ETF EURO STOXX 50® EQUAL WEIGHT NR	LU0599613063	-17,31% (vs -15,93% pour l'EURO STOXX 50 index NR)	31,38% (vs 29,79% pour l'EURO STOXX 50 index NR)
OSSIAM ETF STOXX® EUROPE 600 EQUAL WEIGHT NR	LU0599613147	-7,06% (vs -3,74% pour le STOXX Europe 600 index NR)	25,48% (vs 22,93% pour le STOXX Europe 600 index NR)

La performance passée n'est pas un indicateur fiable de la volatilité future.

** La performance à 1 an est calculée pour la période allant du 29 juin 2011 au 29 juin 2012 pour les ETF, sur la base de la valeur liquidative (NAV) et à la clôture de l'indice Net Return. L'ETF supporte un ratio de dépenses totales (TER – composé par exemple de frais de gestion et d'autres dépenses liées au compte) et des coûts de transaction qui ne sont pas pris en compte dans le calcul des performances de l'indice.*

*** La volatilité est calculée sur la période du 29 juin 2011 au 29 juin 2012.*

(Source Bloomberg – calculs par Ossiam)

Ossiam a remporté l'Actif d'Argent dans la catégorie OPCVM avec ses ETF (Exchange Traded Funds) « Equal Weight », lors de l'édition 2012 des Actifs du Patrimoine de l'AGEFI. Ce prix qui récompense les meilleures offres de produits patrimoniaux sur le plan de l'innovation et de la distribution a été attribué à Ossiam pour ses ETF sur indices de stratégies équi-pondérés. Le fonds OSSIAM ETF EURO STOXX 50® EQUAL WEIGHT NR avait déjà été élu "ETF le plus innovant de l'année" par Feri Eurorating et le magazine allemand Capital, en novembre dernier.

En 2012, Ossiam a listé un nouvel ETF de stratégie, élargissant sa gamme de produits cotés sur NYSE Euronext Paris à 7 fonds. Le nouveau fonds a été baptisé *OSSIAM ETF EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR (EUR)*.

Les ETF de stratégie d'Ossiam représentent près de 346 millions d'euros d'actifs sous gestion au 29 Juin 2012.

Contacts Presse :

Ossiam

FTI Consulting Strategic Communications

Guillaume Granier / Nicolas Jehly

Téléphone : +33 1 47 03 68 10

Guillaume.granier@fticonsulting.com

Nicolas.jehly@fticonsulting.com

Natixis Global Asset Management

Christian Silianoff

Téléphone : +33 1 78 40 90 44

Christian.silianoff@globalam.natixis.com

A propos d'Ossiam

Ossiam est une société de gestion spécialiste du smart beta affiliée à Natixis Global Asset Management. Basée à Paris, Ossiam entend être la première société en Europe proposant une gamme diversifiée d'ETF sur indices de stratégie, reposant sur des analyses quantitatives et fondamentales rigoureuses. Ses dirigeants réunissent des expertises complémentaires couvrant à la fois la gestion d'actifs, la recherche quantitative et fondamentale, la structuration de fonds, la maîtrise des risques de marché et des risques opérationnels et le trading.

www.ossiam.com

A propos de Natixis Global Asset Management

Natixis Global Asset Management figure parmi les quinze premiers asset managers mondiaux en termes d'encours sous gestion². Ses sociétés de gestion affiliées offrent des produits de placements conçus pour accroître et protéger le patrimoine et le capital retraite d'une clientèle d'investisseurs institutionnels et de particuliers. Son réseau de distribution propre lui permet d'offrir les produits de ses filiales à travers le monde. Natixis Global Asset Management met en commun les compétences d'un ensemble de sociétés de gestion spécialisées en Europe, aux Etats-Unis et en Asie pour offrir une large gamme de stratégies de placements en actions, obligations et gestion alternative.

Natixis Global Asset Management, dont le siège est situé à Paris et à Boston, totalisait un encours sous gestion de €562 milliards au 31 mars 2012.

Natixis Global Asset Management est une filiale de Natixis. Coté à la Bourse de Paris, Natixis est une filiale de BPCE, le 2^{ème} groupe bancaire français. Les sociétés affiliées de gestion d'actifs, de distribution et de services de Natixis Global Asset Management sont les suivantes : Absolute Asia Asset Management ; AEW Capital Management; AEW Europe ; AlphaSimplex Group; Aurora Investment Management ; Capital Growth Management ; Caspian Private Equity ; Darius Capital Partners ; Gateway Investment Advisers ; H20 Asset Management ; Hansberger Global Investors ; Harris Associates ; Loomis Sayles & Company ; IDFC Asset Management Company ; Natixis Asset Management ; Natixis Multimanager ; Ossiam ; Reich & Tang Asset Management ; Snyder Capital Management ; Vaughan Nelson Investment Management.

² Cerulli Quantitative Update: Global Markets 2012, classé 13^{ème} asset manager mondial en termes d'encours sous gestion au 31 Décembre 2011 avec un AUM de \$706 milliards