

## Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)

### DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value è un approccio sistematico di tipo Value che si basa sulle ricerche del Professor Robert Shiller. Tale strategia offre un'esposizione al mercato azionario europeo attraverso la rotazione settoriale basata sull'indicatore Cyclically Adjusted Price-to-Earnings (CAPE®) per selezionare quei settori potenzialmente sottovalutati. Questa strategia è stata creata per offrire un'esposizione al mercato azionario ad alta capitalizzazione con uno stile Value ed è adatta agli investitori buy-and-hold con un orizzonte temporale pluriennale.

- Esposizione ai titoli europei attraverso un approccio di selezione di settori industriali basato sull'indicatore CAPE®
- Metrica di valutazione ampiamente utilizzata che si basa sui lavori del Professor Shiller
- Un processo di investimento che intende identificare quei settori potenzialmente sottovalutati nel lungo periodo

### RENDIMENTO DEL PRODOTTO DAL LANCIO

31.10.2018

— Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)  
— MSCI Europe Net Return Index (EUR)



Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, Calcoli di Ossiam

### RENDIMENTI DAL LANCIO

31/10/2018

|                             | MTD rendimen-<br>to % | YTD rendimento<br>% | Rendimento<br>1-anno % | Rendimento<br>annualizzato<br>3-anno % | Rendimento<br>annualizzato<br>5-anno % | Rendimento<br>annualizzato dal<br>lancio % |
|-----------------------------|-----------------------|---------------------|------------------------|--|--|--|
| Fondo                       | -3,40                 | -3,84               | -6,31                  | 1,21                                   | —                                      | 3,16                                       |
| Indice                      | -3,36                 | -3,42               | -5,80                  | 1,86                                   | —                                      | 3,86                                       |
| Universo di<br>investimento | -5,31                 | -4,51               | -5,45                  | 1,64                                   | —                                      | 4,26                                       |

Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, Calcoli di Ossiam

### PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO

(31.10.2018)

|                                  | Volatilità %<br>Annualizzato | Alpha %<br>Annualizzato | BETA | Tracking<br>Error %<br>1-Anno | SHARPE<br>RATIO | MAX<br>DRAWDOWN % |
|----------------------------------|------------------------------|-------------------------|------|-------------------------------|-----------------|-------------------|
| Fondo                            | 16,92                        | -0,97                   | 0,97 | 0,04                          | 0,19            | -23,68            |
| Indice                           | 16,92                        | -0,27                   | 0,97 | —                             | 0,23            | -23,27            |
| Universo di<br>investi-<br>mento | 16,79                        | —                       | —    | —                             | 0,25            | -25,92            |

Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, Calcoli di Ossiam

**INFORMAZIONE IMPORTANTE:** Il valore dell'investimento e il suo guadagno possono variare così che il vostro investimento iniziale non può essere garantito. Gli ETFs si scambiano sul mercato come azioni e sono acquistati e venduti a prezzi di mercato che possono essere diversi dal loro net asset value. I rendimenti passati non sono un indicatore affidabile dei rendimenti futuri.

**Considerazioni di rischio:** Si noti che il fondo è soggetto ai rischi specifici quali i rischi dell'indice, derivati, rischio di controparte e concentrazione geografica. Oltre al rischio di mercato, Per saperne di più sui rischi si prega di far riferimento al Key Investor Information Document e al Prospetto del fondo prima di investire.

## INDICATORE SINTETICO DI RISCHIO E RENDIMENTO

RISCHIO PIÙ BASSO RISCHIO PIÙ ELEVATO



RENDIMENTO  
TIPICAMENTE PIÙ  
BASSO

RENDIMENTO  
TIPICAMENTE PIÙ  
ELEVATO

Lo SRRI rappresenta il profilo di rendimento e rischio così come delineati nel Key Investor Information Document (KIID). La categoria più bassa non implica l'assenza di rischio. Lo SRRI non è una garanzia e può cambiare nel tempo.

### DATI DELL'INDICE

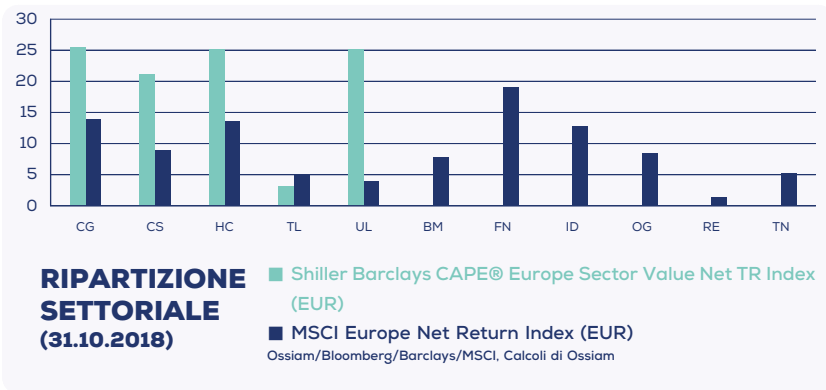
|                               |   |
|-------------------------------|---|
| Nome                          | Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (EUR) |
| Universo di investimento      | MSCI Europe Net Return Index (EUR)                            |
| Ticker Bloomberg              | BXICESE Index   |
| Data di lancio                | 29.08.2013  |
| Asset Class                   | Azioni  |
| Frequenza dei ribilanciamenti | Mensile   |

### DATI DI FONDO

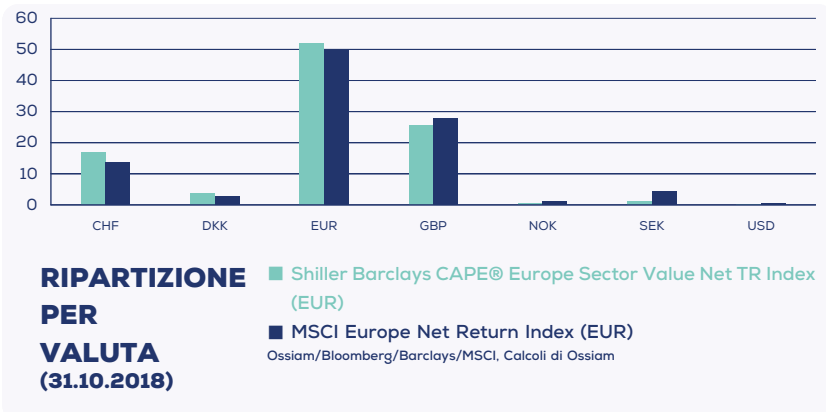
|                      |                                      |
|----------------------|--------------------------------------|
| Depositaria          | State Street Bank Luxembourg S.A     |
| Forma giuridica      | Compartimento della SICAV Ossiam Lux |
| UCITS                | Si                                   |
| Dividendi            | Reinvestiti                          |
| AuM totale del fondo | EUR 65.582.049                       |
| AuM della classe     | EUR 65.582.049                       |
| Net Asset value      | EUR 299,336                          |
| Numero di azioni     | 219.092                              |
| Valuta del fondo     | EUR                                  |
| Valuta della classe  | EUR                                  |
| ISIN                 | LU1079842321                         |
| Data di lancio       | 30.12.2014                           |
| Metodo di replica    | Sintetico                            |
| Total Expense Ratio  | 0,65%                                |

### INFORMAZIONI

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| Cut-off                                    | 14:45 (ora del Lussemburgo) |
| Investimento minimo sur mercato secondario | 1 Azione                    |
| Borsa Italiana Ticker                      |                             |
| Ticker Bloomberg                           | CAPE IM                     |



BM: Basic Materials • CG: Consumer Goods • CS: Consumer Services • FN: Financials • HC: Health Care • ID: Industrials • OG: Oil - Gas • RE: Real Estate • TL: Telecommunications • TN: Technology • UL: Utilities



CHF: Swiss Franc • DKK: Danish krone • EUR: Euro • GBP: British Pound • NOK: Krona Norvegia • SEK: Swedish Krona • USD: US Dollar

## TOP 10 HOLDINGS (%)

31.10.2018

|                              | Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index | MSCI Europe Net Return Index |
|------------------------------|---|------------------------------|
| NESTLE SA                    | 5,76  | 3,16                         |
| NOVARTIS AG                  | 4,21  | 2,28                         |
| ROCHE HOLDING AG             | 3,79  | 2,05                         |
| IBERDROLA SA                 | 3,42  | 0,51                         |
| ENEL SPA                     | 3,23  | 0,48                         |
| NATIONAL GRID PLC            | 2,88  | 0,43                         |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 2,41  | 1,02                         |
| SANOFI                       | 2,22  | 1,20                         |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 2,18  | 1,19                         |
| ASTRAZENECA PLC              | 2,15  | 1,16                         |

Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI. Calcoli di Ossiam

## CONTATTI/INFORMAZIONI

[www.ossiam.com](http://www.ossiam.com)

mail : [info@ossiam.com](mailto:info@ossiam.com)

TEL +33 1 84 79 42 70

80 av. de la Grande Armée

75017 PARIS - FRANCE

Il presente documento è un documento a carattere puramente commerciale e in nessun modo un documento a carattere regolamentare.

Ossiam Lux (la « SICAV ») è una Société d'Investissement à Capital Variable lussemburghese composta da diversi comparti distinti (che costituiscono ciascuno un « Fondo »). La SICAV ha ricevuto il visa dalla Commission de Surveillance du Secteur Financier del Granducato del Lussemburgo. La SICAV ha nominato Ossiam quale società di gestione, responsabile della gestione finanziaria dei fondi, l'amministrazione e la distribuzione della SICAV. La società di gestione ha nominato State Street Luxembourg in qualità di Agente Amministrativo, Agente Pagatore, Agente di domiciliazione et Corporate Agent, Agente di registro e di trasferimento della SICAV. Ossiam, filiale di Natixis Investment Managers (precedentemente Natixis Global Asset Management), è autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers in qualità di società di gestione di portafoglio con il numero GP-10000016.

Il Fondo OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) non è in alcun modo sponsorizzato, avallato o promosso da BARCLAYS. BARCLAYS non è in alcun caso responsabile di eventuali errori, omissioni o interruzioni dell'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index. Barclays Bank PLC e le sue controllate e/o consociate ("Barclays") non è l'emittente o il produttore di Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index e Barclays non ha responsabilità, obblighi o doveri nei confronti degli investitori in OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) se non in relazione alla loro distribuzione ai sensi del contratto stipulato con OSSIAM. L'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index è un marchio di proprietà di Barclays Bank PLC o di Barclays Capital Inc., concesso in licenza d'uso a OSSIAM in qualità di Emittente di OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR). Inoltre, l'Emittente di Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR può concludere per conto proprio operazioni con Barclays relative all'Indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR in relazione all'Indice Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR, tuttavia gli investitori acquistano l'Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR da Ossiam Lux e gli investitori non acquistano alcuna partecipazione nell'Indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR né stabiliscono un rapporto di qualsiasi natura con Barclays per effetto di aver investito nell'indice Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR. Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR non è sponsorizzato, supportato, venduto o promosso da Barclays se non in relazione alla sua distribuzione ai sensi di un contratto con Ossiam. Barclays non è responsabile nei confronti dell'Emittente, gli investitori o qualsiasi terza parte con riferimento all'uso o all'accuratezza di Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Indexe/o di qualsiasi dato ivi contenuto.

L'ACCESSO AI PRODOTTI E SERVIZI PRESENTATI IN QUESTA PRESENTAZIONE PUO' ESSERE SOTTOMESSA A RESTRIZIONI PER ALCUNE PERSONE O PAESI, PER VIA DI UN DIVIETO GENERALE O IN VIRTU' DI REGOLE DI MARKETING. DI CONSEGUENZA, OSSIAM NON OFFRE ALCUN PRODOTTO O SERVIZIO PRESENTATO SU QUESTO DOCUMENTO A QUALSIASI PERSONA NON AUTORIZZATA GIURIDICAMENTE, E LA RESTRIZIONE RESTA APPLICABILE PER I PAESI IN CUI OSSIAM NON HA CHIESTO L'AUTORIZZAZIONE ALLA COMMERCIALIZZAZIONE.