

Ossiam Japan Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Minimum Variance è un approccio all'investimento che ha lo scopo di ridurre la volatilità rispetto ai benchmark ponderati per capitalizzazione di mercato, mantenendo allo stesso tempo un alto livello di diversificazione.

La strategia utilizza stime del rischio dei titoli individuali e le correlazioni così da poter costruire un portafoglio long only con uno stile difensivo.

Questo approccio è adatto agli investitori buy-and-hold con un orizzonte temporale pluriennale in cerca di un'esposizione al mercato azionario con una volatilità decisamente inferiore.

- Esposizione al premio di rischio azionario
- Obiettivo di riduzione della volatilità
- Benefici provenienti dalla cosiddetta low-volatility anomaly

RENDIMENTO DEL PRODOTTO DAL LANCIO

28.12.2018

Ossiam Japan Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)
S&P/TOPIX 150 Net TR Index (EUR)



Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

RENDIMENTI DAL LANCIO

28/12/2018

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anno %	Rendimento annualizzato 5-anno %	Rendimento annualizzato dal lancio %
Fondo	-5,29	-4,72	-4,72	3,13	-	3,58
Indice	-5,25	-4,09	-4,09	3,92	11,00	4,38
Universo di investimento	-8,08	-8,86	-8,86	1,68	-	2,19

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO

(28.12.2018)

	Volatilità % Annualizzato	Alpha % Annualizzato	BETA	Tracking Error % 1-Anno	SHARPE RATIO	MAX DRAWDOWN %
Fondo	15,63	1,81	0,81	0,12	0,23	-15,60
Indice	15,64	2,61	0,81	-	0,28	-15,51
Universo di investimento	18,06	-	-	-	0,12	-20,37

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, 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.

La classe denominata in Euro non include strumenti di hedge contro il rischio di cambio.

INDICATORE SINTETICO DI RISCHIO E RENDIMENTO



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	Japan Minimum Variance Index NR (JPY)
Universo di investimento	S&P/TOPIX 150 Net TR Index (JPY)
Ticker Bloomberg	JPMVNR Index
Data di lancio	05.10.2015
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	JPY 2.540.932.054
AuM della classe	EUR 20.124.634
Net Asset value	EUR 95.553
Numero di azioni	210.613
Valuta del fondo	JPY
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU1254453738
Data di lancio	21.12.2015
Metodo di replica	Fisico
Total Expense Ratio	0,65%

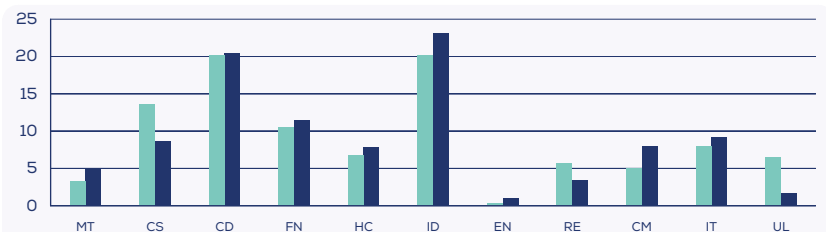
INFORMAZIONI

Cut-off	17:00 (ora del Lussemburgo) del giorno di negoziazione precedente
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
	Borsa Italiana Ticker
Ticker Bloomberg	JPMV IM

TOP 10 HOLDINGS (%)
28.12.2018

	Japan Minimum Variance Index NR	S&P/TOPIX 150 Net TR Index
TOSHIBA CORP	3,64	0,67
JAPAN TOBACCO INC	3,50	0,98
mitsubishi heavy industries	3,41	0,45
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	3,40	1,44
NEC CORP	3,29	0,28
NITORI HOLDINGS CO LTD	3,23	0,40
KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC	3,11	0,21
SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	2,80	1,27
SHIMANO INC	2,79	0,44
JAPAN AIRLINES CO LTD	2,76	0,45

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam



RIPARTIZIONE SETTORIALE
(28.12.2018)

■ Japan Minimum Variance Index NR (JPY)

■ S&P/TOPIX 150 Net TR Index (JPY)
Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

MT : Materials • CS : Consumer Staples • CD : Consumer Discretionary • FN : Financials • HC : Health Care • ID : Industrials • EN : Energy • RE : Real Estate • CM : Communications Services • IT : Information Technology • UL : Utilities

CONTATTI/INFORMAZIONI

www.ossiam.com

mail : 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 Natix Investment Managers (precedentemente Natix Global Asset Management), è autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers in qualità di società di gestione di portafoglio con il numero GP-10000016.

OSSIAM ha affidato a S&P Opco LLC, un'affiliata di S&P Dow Jones Indices, il calcolo e la manutenzione di JAPAN MINIMUM VARIANCE INDEX NR e JAPAN MINIMUM VARIANCE EURO HEDGED INDEX NR (gli "Indici"). Gli Indici non sono sponsorizzati da S&P Dow Jones Indices LLC o da sue affiliate o licenziatari terzi, ivi compresi Standard & Poor's Financial Services LLC e Dow Jones Trademark Holdings LLC (collettivamente "S&PDow Jones Indices"). S&P Dow Jones Indices non sarà responsabile per errori od omissioni nel calcolo degli Indici. "Calcolato da S&P Dow Jones Indices" e i relativi marchi stilizzati sono marchi di servizio di S&P Dow Jones Indices e sono stati concessi in licenza per l'uso da parte di OSSIAM. S&P® è un marchio registrato di Standard & Poor's Financial Services LLC, e Dow Jones® è un marchio registrato di Dow Jones Trademark Holdings LLC. S&P DOW JONES INDICES NON GARANTISCE L'ADEGUATEZZA, L'ACCURATEZZA, LA TEMPSTICA E/O LA COMPLETEZZA DEGLI INDICI NÉ DI QUALSIASI DATO IN ESSI CONTENUTO NÉ DI EVENTUALI COMUNICAZIONI COMPRESSE - IN VIA NON LIMITATIVA - COMUNICAZIONI ORALI O SCRITTE (COMPRESSE LE COMUNICAZIONI IN FORMATO ELETTRONICO). S&P DOW JONES INDICES NON SARÀ RESPONSABILE PER DANNI NÉ PERSEGUIBILE PER ERRORI, OMISSIONI O RITARDI RISPETTO A QUANTO SOPRA. S&P DOW JONES INDICES NON FORMULA ALCUNA GARANZIA ESPRESSA O IMPLICITA E RIFIUTA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA DI COMMERCIALIZZABILITÀ O IDONEITÀ PER UNO SCOPO O USO PARTICOLARE O RELATIVAMENTE AI RISULTATI DA OTTENERE DA PARTE DI OSSIAM, DEI PROPRIETARI DEL FONDO O DI QUALSIASI ALTRO SOGGETTO O ENTITÀ IN SEGUITO ALL'USO DEGLI INDICI O ALTRI DATI AD ESSI CORRELATI. SENZA LIMITAZIONE ALCUNA RISPETTO A QUANTO SOPRA, IN NESSUN CASO S&P DOW JONES INDICES SARÀ RESPONSABILE PER DANNI INDIRETTI, SPECIALI, INCIDENTALI, PUNITIVI O CONSEGUENZIALI COMPRESI IN VIA NON LIMITATIVA PERDITA DI PROFITTI, PERDITE COMMERCIALI, PERDITA DI TEMPO O DI CLIENTI, ANCHE QUALORA SIA STATA COMUNICATA LA POSSIBILITÀ DI TALI DANNI IN TERMINI CONTRATTUALI, DI TORTO, RESPONSABILITÀ OGGETTIVA O ALTRO.

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.