

Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity Ex Grains TR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Risk Weighted Enhanced Commodity è un approccio sistematico "long-only" che tende ad offrire un'esposizione alle materie prime con una volatilità ridotta rispetto all'universo di investimento. Rispetto agli indici standard, fortemente concentrati ed esposti al rischio di contango, la strategia Risk Weighted Enhanced Commodity combina una efficiente allocazione dei rischi a tecniche di ottimizzazione del roll dei contratti futures al fine di limitarne gli effetti negativi.

- Esposizione all'universo delle materie prime, cereali esclusi
- Riduzione del rischio
- Diversificazione ed ottimizzazione del roll.

RENDIMENTO DEL PRODOTTO DAL LANCIO

31.12.2018

— Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity Ex Grains TR UCITS ETF 1C (EUR)
— S&P GSCI® Index (EUR)



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

RENDIMENTI DAL LANCIO

31/12/2018

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anno %	Rendimento annualizzato 5-anno %	Rendimento annualizzato dal lancio %
Fondo	-3,21	-5,31	-5,31	2,02	-0,27	-0,85
Indice	-3,18	-4,97	-4,97	2,42	0,26	-0,30
Universo di investimento	-8,63	-9,47	-9,47	-1,19	-11,26	-11,35

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

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO (31.12.2018)

	Volatilità % Annualizzato	Alpha % Annualizzato	BETA	Tracking Error % 1-Anno	SHARPE RATIO	MAX DRAWDOWN %
Fondo	11,57	4,54	0,47	0,04	-0,07	-27,71
Indice	11,58	5,09	0,48	—	-0,03	-27,00
Universo di investimento	20,12	—	—	—	-0,56	-57,20

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 Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR (USD)

Universo di investimento S&P GSCI® Index (USD)

Ticker Bloomberg OCMDRWT Index

Data di lancio 25.02.2013

Asset Class Materie Prime

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 USD 55.060.010

AuM della classe EUR 42.352.163

Net Asset value EUR 67.359

Numero di azioni 628.750

Valuta del fondo USD

Valuta della classe EUR

ISIN LU0876440578

Data di lancio 05.07.2013

Metodo di replica Sintetico

Total Expense Ratio 0,45%

INFORMAZIONI

Cut-off 16:00 (ora del Lussemburgo)

Investimento minimo sul mercato secondario 1 Azione

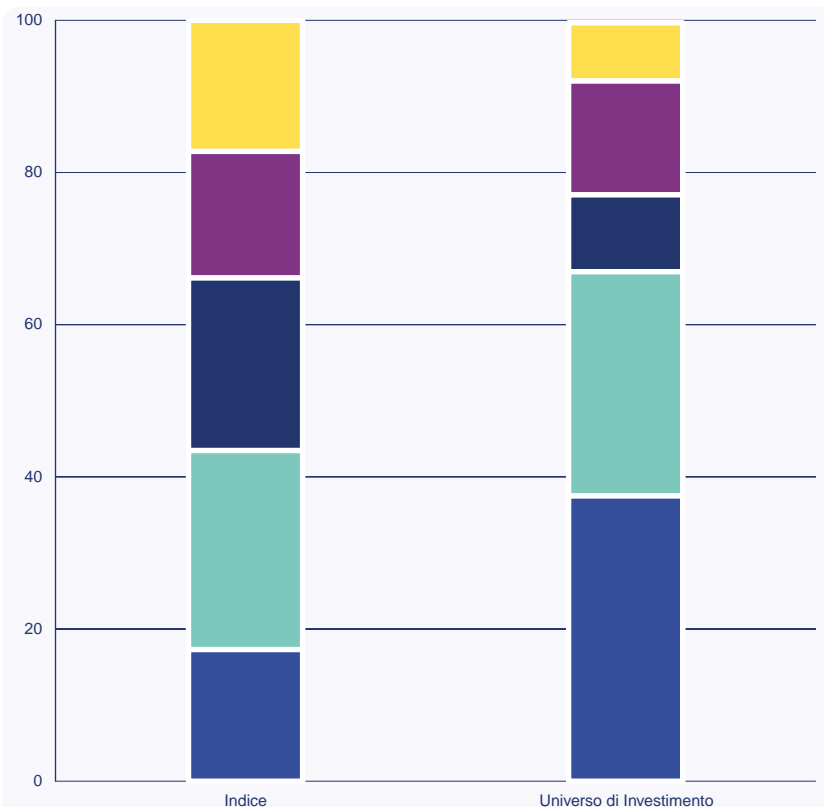
Borsa Italiana Ticker

Ticker Bloomberg CRWE IM

TOP 10 HOLDINGS (%)
31.12.2018

	Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR
S&P GSCI GOLD DYNAMIC ROLL INDEX ER	10,67
S&P GSCI LIVE CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	7,11
SILVER DYNAMIC ER	6,56
S&P GSCI FEEDER CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	6,40
S&P GSCI NATURAL GAS DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,98
S&P GSCI COPPER DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,58
S&P GSCI COTTON DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,00
S&P GSCI GASOIL DYNAMIC ROLL INDEX ER	4,94
S&P GSCI ALUMINUM DYNAMIC ROLL INDEX ER	4,91
S&P GSCI HEATING OIL DYNAMIC ROLL INDEX ER	4,35
S&P GSCI® Index	
S&P GSCI CRUDE OIL INDEX TR	14,54
S&P GSCI CORN INDEX TR	12,80
S&P GSCI LIVE CATTLE TR	11,04
S&P GSCI WHEAT INDEX TR	8,69
S&P GSCI SOYBEAN INDEX TR	8,27
S&P GSCI COPPER INDEX TR	7,48
S&P GSCI GOLD INDEX TR	6,68
S&P GSCI BRENT CRUDE INDEX TR	5,76
S&P GSCI HEATING OIL INDEX TR	3,64
S&P GSCI SUGAR INDEX TR	3,56

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



COMMODITY ALLOCATION (31.12.2018)

- Agricoltura
- Energia
- Metalli industriali
- Bestiame
- Metalli preziosi

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

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.

L'OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR non è sponsorizzato, approvato, venduto né promosso da Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"), da sue affiliate o licenziatari terzi. Né S&P, né le sue affiliate né tantomeno eventuali licenziatari terzi potranno offrire informazioni o garanzie - espresse o implicite - ai detentori dell' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR o a chiunque altro in merito all'opportunità di investire in titoli in generale o nell' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR in particolare, né in merito alla capacità del Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index Total Return USD (l'"Indice") di ottenere performance generali sul mercato delle materie prime. L'unico rapporto di S&P e dei licenziatari terzi con Ossiam consiste nella concessione in licenza di alcuni marchi, marchi di servizio e nomi commerciali di S&P e/o dei suoi licenziatari terzi e nella fornitura di servizi di calcolo e manutenzione associati all'Indice. Né S&P, né le sue affiliate o i licenziatari terzi saranno responsabili o parteciperanno alla determinazione dei prezzi e degli importi dell' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR né avranno voce sulla determinazione o sul calcolo dell'equazione con la quale l' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR viene convertito in liquidità. S&P non avrà alcun obbligo o responsabilità in termini di amministrazione, promozione o negoziazione dell' OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR. NÉ S&P, NÉ LE SUE AFFILIATE NÉ TANTOMENO I SUOI LICENZIATARI TERZI GARANTISCONO L'ADEGUATEZZA, L'ACCURATEZZA, LA TEMPSTICA O LA COMPLETEZZA DELL'INDICE NÉ DI QUALSIASI DATO IN ESSO CONTENUTO NÉ DI EVENTUALI COMUNICAZIONI COMPRESSE - IN VIA NON LIMITATIVA - COMUNICAZIONI ORALI O SCRITTE (COMPRESSE LE COMUNICAZIONI IN FORMATO ELETTRONICO) AL RIGUARDO. S&P, LE SUE AFFILIATE E I SUOI LICENZIATARI TERZI NON SARANNO RESPONSABILI PER DANNI NÉ PERSEGUIBILI PER ERRORI, OMISSIONI O RITARDI RISPETTO A QUANTO SOPRA. S&P NON FORMULA ALCUNA GARANZIA ESPRESSA O IMPLICITA E RIFIUTA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA DI COMMERCIALITÀ O IDONEITÀ PER UNO SCOPO O USO PARTICOLARE RISPETTO AI PROPRI MARCHI, ALL'INDICE O AI DATI IN ESSO CONTENUTI. SENZA LIMITAZIONE ALCUNA RISPETTO A QUANTO SOPRA, IN NESSUN CASO S&P, LE SUE AFFILIATE O I SUOI LICENZIATARI TERZI SARANNO RESPONSABILI 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. Standard & Poor's® e S&P® sono marchi registrati di Standard & Poor's Financial Services LLC. "Calculated by S&P Custom Indices" e il relativo marchio stilizzato sono marchi di servizio di Standard & Poor's Financial Services LLC concessi in licenza a Ossiam.

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.