

Ossiam Emerging Markets 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 dei rischi 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

31.12.2018

— Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)
— SP/IFCI® Composite NR (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	-1,71	-2,36	-2,36	6,04	4,24	4,42
Indice	-1,57	-0,73	-0,73	7,78	5,99	6,18
Universo di investimento	-3,50	-10,24	-10,24	7,21	6,14	4,06

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	12,52	1,35	0,76	0,07	0,35	-27,92
Indice	12,53	3,11	0,76	—	0,49	-27,05
Universo di investimento	15,01	—	—	—	0,27	-33,50

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

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	Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)
Universo di investimento	SP/IFCI® Composite NR (USD)
Ticker Bloomberg	OEMMVNR Index
Data di lancio	24.01.2012
Asset Class	Azioni
Frequenza dei ribilanciamenti	Semestrale

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 133.622.484
AuM della classe	EUR 110.987.633
Net Asset value	EUR 107.567
Numero di azioni	1.031.799
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU0705291903
Data di lancio	03.02.2012
Metodo di replica	Sintetico
Total Expense Ratio	0,75%

INFORMAZIONI

Cut-off	16:00 (ora del Lussemburgo) del giorno di negoziazione precedente
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
	Borsa Italiana Ticker
Ticker Bloomberg	EMMV IM

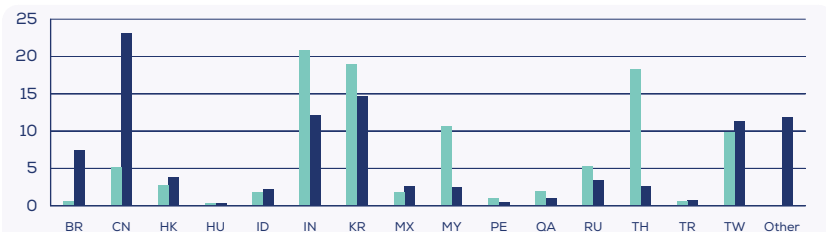
> Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

TOP 10 HOLDINGS (%)

31.12.2018

	Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR	SP/IFCI® Composite NR
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,85	0,09
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,81	0,24
TENAGA NASIONAL BHD	2,75	0,15
PUBLIC BANK BHD	2,62	0,26
SIAM CEMENT PCL/THE	2,01	0,07
BANGKOK DUSIT MED SERVICE	2,00	0,05
QATAR NATIONAL BANK	1,95	0,41
CHINA MOBILE LTD	1,91	0,92
MALAYAN BANKING BHD	1,81	0,21
SK TELECOM CO LTD	1,81	0,17

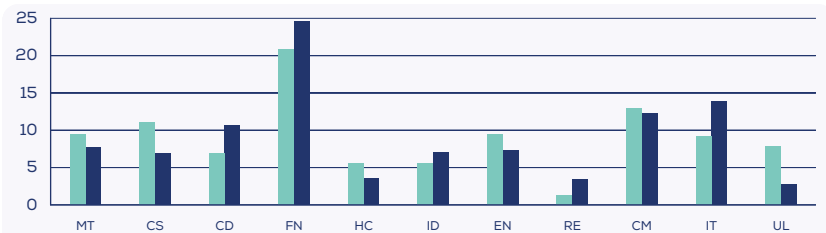
Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam



RIPARTIZIONE GEOGRAFICA (31.12.2018)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)
■ SP/IFCI® Composite NR (USD)
Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

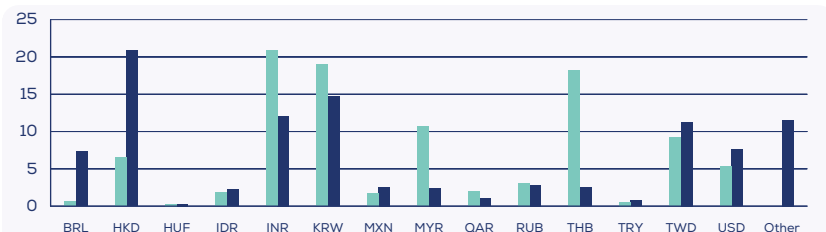
BR: Brazil • CN: China • HK: Hong Kong • HU: Hungary • ID: Indonesia • IN: India • KR: Korea • MX: Mexico • MY: Malaysia • PE: Peru • QA: Qatar • RU: Russian Federation • TH: Thailand • TR: Turkey • TW: Taiwan



RIPARTIZIONE SETTORIALE (31.12.2018)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)
■ SP/IFCI® Composite NR (USD)
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



RIPARTIZIONE PER VALUTA (31.12.2018)

■ Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)
■ SP/IFCI® Composite NR (USD)
Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

BRL: Brazil Real • HKD: Hong Kong Dollar • HUF: Hungarian Forint • IDR: Indonesian Rupiah • INR: Indian Rupiah • KRW: South Korean Won • MXN: Mexican Peso • MYR: Malaysian Ringgit • QAR: Qatar Riyal • RUB: Russian Ruble • THB: Thai Baht • TRY: Turkish Lira • TWD: Taiwan New Dollar • USD: US Dollar

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 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.

L'OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR 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 EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR o a chiunque altro in merito all'opportunità di investire in titoli in generale o nell' OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR in particolare né in merito alla capacità dell'Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index Net Return USD (l'« Indice ») di ottenere performance generali sul mercato azionario. 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 EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR né avranno voce sui tempi di emissione o vendita dell' OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR né sulla determinazione o sul calcolo dell'equazione con la quale l' OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR viene convertito in denaro liquido. S&P non avrà alcun obbligo o responsabilità in termini di amministrazione, promozione o negoziazione dell' OSSIAM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR.

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.