

Ossiam US Minimum Variance ESG 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.

Il processo di ottimizzazione viene applicato ad una vasta gamma di titoli filtrati attraverso i criteri ESG (mantenendo il 70% dei titoli con il miglior rating 'all'interno di ogni peer group ed escludendo i titoli esposti a controversia grave in base ai livelli di rating di Sustainalytics, agli armamenti controversi e in breach con i principi delle Nazioni Unite Global Compact).

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

- Esposizione al premio di rischio azionario ma coerente con un approccio ESG
- Obiettivo di riduzione della volatilità
- Benefici provenienti dall'anomalia della scarsa volatilità

RENDIMENTO DEL PRODOTTO DAL LANCIO

31.12.2018

— Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF 1C (EUR)
— Solactive US Large Cap Net TR Index* (EUR)



Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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	-8,13	3,04	3,04	5,16	10,35	12,92
Indice	-8,08	3,44	3,44	5,47	10,56	13,15
Universo di investimento	-9,85	0,00	0,00	6,76	11,93	14,44

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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	13,21	2,01	0,76	0,40	0,98	-18,13
Indice	13,21	2,25	0,76	—	1,00	-18,16
Universo di investimento	16,17	—	—	—	0,89	-18,46

Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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.

* L'indice di Riferimento (risp. Il Benchmark) è calcolato utilizzando le performances dell'Ossiam US Minimum Variance NR (risp. S&P 500 Index NR) fino al 16 Giugno 2017 e le performances dell' US ESG Minimum Variance NR Index (risp. Solactive US Large Cap NR Index) in seguito. Questo metodo di calcolo riflette il cambiamento dell'indice di riferimento e del benchmark effettivo per il fondo alla chiusura del mercato del 16 Giugno 2017.

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	US ESG Minimum Variance Index NR * (USD)
Universo di investimento	Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)
Ticker Bloomberg	ESGUSMVN
Data di lancio	06.06.2011
Asset Class	Azioni
Frequenza dei ribilanciamenti	Mensile

DATI DI FONDO

Depositaria	State Street Bank Luxembourg S.A
Forma giuridica	Compartmento della SICAV Ossiam Lux
UCITS	Si
Dividendi	Reinvestiti
AuM totale del fondo	USD 304.527.926
AuM della classe	EUR 92.985.610
Net Asset value	EUR 167.852
Numero di azioni	553.975
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU0599612685
Data di lancio	15.06.2011
Metodo di replica	Fisico
Total Expense Ratio	0,65%

INFORMAZIONI

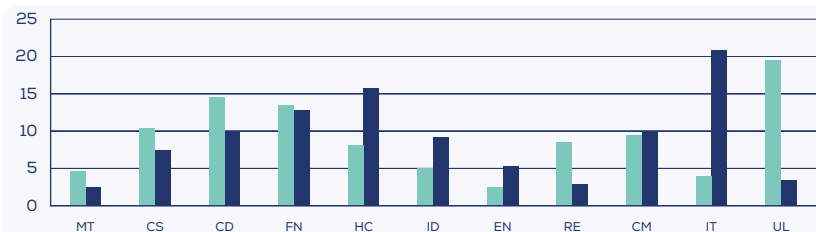
Cut-off	16:15 (ora del Lussemburgo)
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
Borsa Italiana Ticker	
Ticker Bloomberg	SPMV IM

TOP 10 HOLDINGS (%)

31.12.2018

	US ESG Minimum Variance Index NR *	Solactive US Large Cap Net TR Index*	ESG Rating
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	4,60	0,24	50,45
NEWMONT MINING CORP	4,47	0,09	78,08
CME GROUP INC	3,73	0,30	53,17
REPUBLIC SERVICES INC	3,24	0,07	54,88
SEMPRA ENERGY	2,98	0,13	68,75
MCDONALD'S CORP	2,61	0,65	56,05
COCA-COLA CO/THE	2,56	0,86	64,06
MERCK & CO. INC.	2,54	0,97	67,23
CITRIX SYSTEMS INC	2,52	0,06	57,12
NEXTERA ENERGY INC	2,49	0,39	67,02

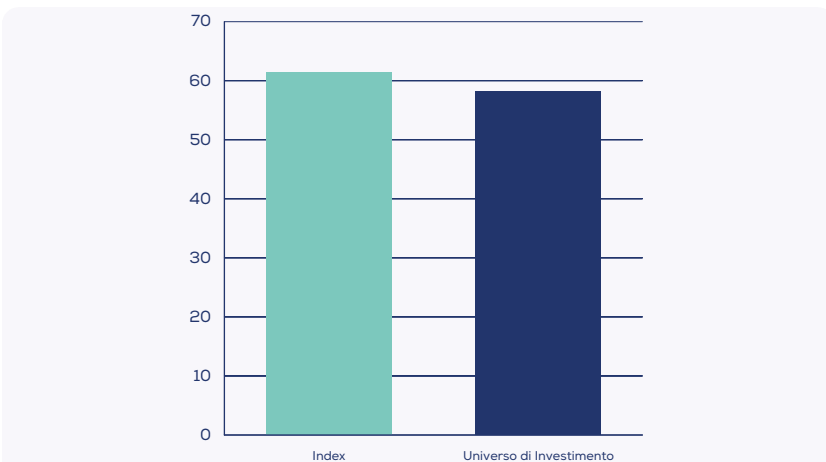
Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, Calcoli di Ossiam



RIPARTIZIONE SETTORIALE (31.12.2018)

■ US ESG Minimum Variance Index NR* (USD)
 ■ Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)
 Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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



RATING ESG MEDIO (31.12.2018)

■ US ESG Minimum Variance Index NR* (USD)
 ■ Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)
 Ossiam/Bloomberg/Standard & Poor's/Solactive AG/Sustainalytics, 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 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.

Lo strumento finanziario OSSIAM US ESG MINIMUM VARIANCE NR non è sponsorizzato, pubblicizzato, commercializzato o in alcun modo promosso da Solactive AG, la quale non fornisce alcuna garanzia o assicurazione, esplicita o implicita, sui risultati conseguibili tramite l'uso dell'Indice e/o del marchio dell'Indice o del suo Prezzo, senza limitazioni temporali e a prescindere da qualsiasi altro aspetto. L'Indice è calcolato e pubblicato da Solactive AG. Solactive AG fa tutto quello che è nelle sue capacità perché l'Indice sia calcolato correttamente. A prescindere dai suoi obblighi nei confronti dell'Emittente, Solactive AG non ha alcun obbligo di rendere noti gli errori nell'Indice a terzi, ivi compresi gli Investitori e/o gli intermediari finanziari dello strumento finanziario. Né la pubblicazione dell'Indice da parte di Solactive AG, né la concessione in licenza dello stesso o del suo marchio con finalità collegate allo strumento finanziario, costituisce un invito da parte di Solactive AG a investire nel suddetto strumento, ovvero una garanzia o un parere, di qualsiasi sorta, da parte di Solactive AG, sull'eventuale investimento nello strumento in questione.

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.