

Ossiam iSTOXX Europe 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

31.12.2018

— Ossiam iSTOXX Europe Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)
— STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)



Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, 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	-5,57	-5,04	-5,04	0,69	5,29	7,28
Indice	-5,54	-4,86	-4,86	0,95	5,62	7,66
Universo di investimento	-5,46	-10,77	-10,77	-0,04	3,42	5,91

Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, 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	11,62	3,38	0,66	0,10	0,63	-18,39
Indice	11,63	3,75	0,66	—	0,66	-18,06
Universo di investimento	16,13	—	—	—	0,37	-25,21

Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, 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	iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR (EUR)
Universo di investimento	STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)
Ticker Bloomberg	ISEMVT Index
Data di lancio	14.06.2011
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 318.459.131
AuM della classe	EUR 210.317.246
Net Asset value	EUR 164,059
Numero di azioni	1.281.958
Valuta del fondo	EUR
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU0599612842
Data di lancio	21.06.2011
Metodo di replica	Sintetico
Total Expense Ratio	0,65%

INFORMAZIONI

Cut-off	16:00 (ora del Lussemburgo)
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
Borsa Italiana Ticker	
Ticker Bloomberg	EUMV IM

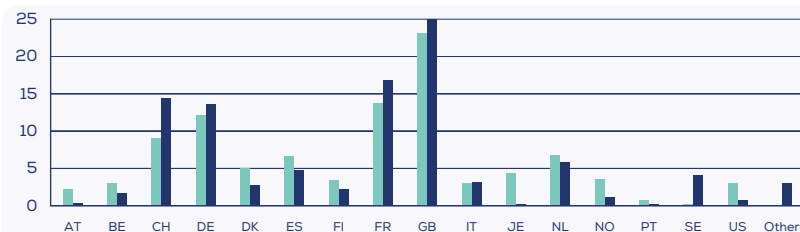
> Ossiam iSTOXX Europe Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

TOP 10 HOLDINGS (%)

31.12.2018

	iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR	STOXX® Europe 600 Index NR
RANDGOLD RESOURCES LTD	4,36	0,09
PEARSON PLC	3,38	0,11
UNILEVER NV	3,07	0,98
AROUNDTOWN SA	2,95	0,07
AKZO NOBEL NV	2,89	0,24
UCB SA	2,75	0,12
SHIRE PLC	2,68	0,64
UNILEVER PLC	2,63	0,74
ASSICURAZIONI GENERALI	2,53	0,27
TESCO PLC	2,47	0,28

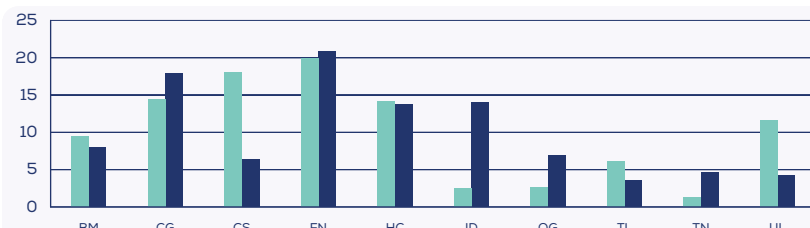
Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, Calcoli di Ossiam



RIPARTIZIONE GEOGRAFICA (31.12.2018)

■ iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR (EUR)
■ STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)
Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, Calcoli di Ossiam.

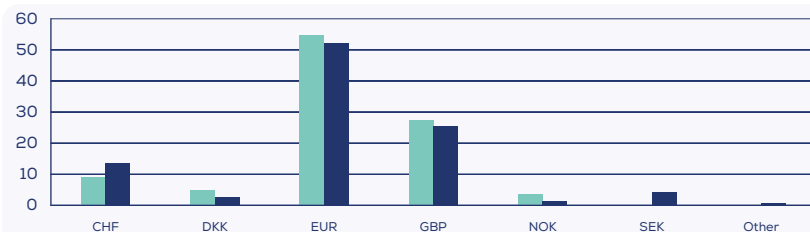
AT: Austria • BE: Belgium • CH: Switzerland • DE: Germany • DK: Denmark • ES: Spain • FI: Finland • FR: France • GB: United Kingdom • IT: Italy • JE: Jersey • NL: Netherlands • NO: Norway • PT: Portugal • SE: Sweden • US: United States



RIPARTIZIONE SETTORIALE (31.12.2018)

■ iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR (EUR)
■ STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)
Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, Calcoli di Ossiam

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



RIPARTIZIONE PER VALUTA (31.12.2018)

■ iSTOXX® Europe Minimum Variance Index NR (EUR)
■ STOXX® Europe 600 Index NR (EUR)
Ossiam/Bloomberg/STOXX Ltd, Calcoli di Ossiam

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

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.

STOXX e i suoi Licenziatari non saranno in alcun modo responsabili rispetto all'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR. In particolare, STOXX e i suoi licenziatari non formulano alcuna garanzia, espressa o implicita, e rifiutano qualsiasi garanzia in merito a quanto segue: I risultati attesi dall' 'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR, dai titolari dell' 'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR o da qualsiasi altra persona rispetto all'uso dell' 'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR e dei dati associati all' 'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR; L'accuratezza o la completezza dell' 'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR e dei dati a questo associati; La commerciabilità e l'idoneità per uno scopo o uso particolare dell' 'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR o dei dati a questo associati; STOXX e i suoi Licenziatari non saranno responsabili per errori, omissioni o sospensioni dell' 'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR o dei dati a questo associati; In nessun caso STOXX né i suoi Licenziatari saranno responsabili per perdite di profitti né per perdite o danni indiretti, punitivi, speciali o consequenziali anche nel caso in cui STOXX o i suoi Licenziatari siano a conoscenza della possibilità che questi si verifichino. Il contratto di licenza tra OSSIAM e STOXX è esclusivamente a loro vantaggio e non dei titolari dell' 'OSSIAM iSTOXX® EUROPE MINIMUM VARIANCE NR né di altri soggetti terzi.

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.