

## Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)

### DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia settoriale di Ossiam dell'ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector mira a realizzare un profilo di rischio/rendimento simile a quello dell'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Index, ma con un'impronta carbonio significativamente ridotta e un profilo ESG migliorato.

La strategia Shiller Barclays CAPE® US Sector Value è una strategia sistematica orientata di tipo Value basata sulle ricerche del professor Robert Shiller. La strategia offre un'esposizione azionaria al mercato statunitense attraverso un approccio di selezione settoriale basato sul criterio del prezzo/utile (CAPE @ Cyclically Adjusted Price to Earnings) al fine di selezionare settori potenzialmente sottovalutati. La strategia è stata progettata per offrire un'esposizione al mercato azionario a grande capitalizzazione con una distorsione di tipo Value per degli investitori buy-and-hold con orizzonte temporale pluriennale.

Miglioramento del profilo ESG: la strategia esclude le società coinvolte nelle armi controverse, nel tabacco, carbone e le controversie di natura ambientale, sociale e di governance.

Impronta carbonio ridotta: la strategia, rispetto al suo indice originale, mira a ridurre del 40% le emissioni totali di gas a effetto serra (GES), l'intensità carbonio (GES /fatturato) e le emissioni GES derivanti dalle riserve di combustibili fossili.

Benefici:

- Esposizione ai titoli azionari statunitensi attraverso un approccio di selezione settoriale basato sul rapporto CAPE®.
- Una metrica di valutazione ampiamente usata basata sui lavori del Professor Shiller.
- Un processo di investimento che cerca di identificare settori potenzialmente sottovalutati nel lungo termine.
- Un approccio che combina i filtri ESG con la riduzione delle emissioni di gas a effetto serra.

### RENDIMENTO DEL PRODOTTO DAL LANCIO

29.03.2019

— Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)  
— S&P 500® Index NR (EUR)



Barclays, Sustainability, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

### RENDIMENTI DAL LANCIO (29.03.2019)

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anno %	Rendimento annualizzato 5-anno %	Rendimento annualizzato dal lancio %
Fondo	3,83	15,77	-	-	-	21,15
Universo di investimento	3,34	15,52	19,21	12,77	14,95	17,91

Barclays, Sustainability, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

### PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO (29.03.2019)

	Volatilità % Annualizzato	Alpha % Annualizzato	BETA	Tracking Error % 1-Anno	SHARPE RATIO	MAX DRAWDOWN %
Fondo	16,89	3,01	1,01	-	1,25	-18,25
Universo di investimento	16,29	-	-	-	1,10	-18,49

Barclays, Sustainability, Trucost, Datastream, 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 di cambio e di ESG e la concentrazione geografica, oltre al rischio del 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



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

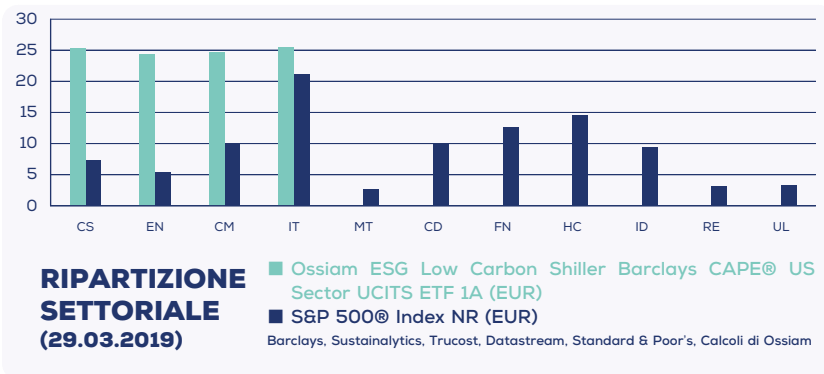
Universo di investimento	S&P 500® Index NR (EUR)
Ticker Bloomberg	SPTR500N Index
Data di lancio	31.12.1998
Asset Class	Azioni
Frequenza dei ribilanciamenti	Mensile

### DATI DI FONDO

Depositaria	BNY Mellon Trust Company (Ireland) Limited.
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam IRL ICAV
UCITS	Si
Dividendi	Reinvestiti
AuM totale del fondo	USD 49.565.055
AuM della classe	EUR 26.092.618
Net Asset value	EUR 62,602
Numero di azioni	416.800
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	IE00BF92LV92
Data di lancio	05.04.2018
Metodo di replica	Sintetico
Total Expense Ratio	0,85%

### INFORMAZIONI

Cut-off	3 p.m. (Irish Time) on the Dealing Day
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
Borsa Italiana Ticker	
Ticker Bloomberg	SHEE IT



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

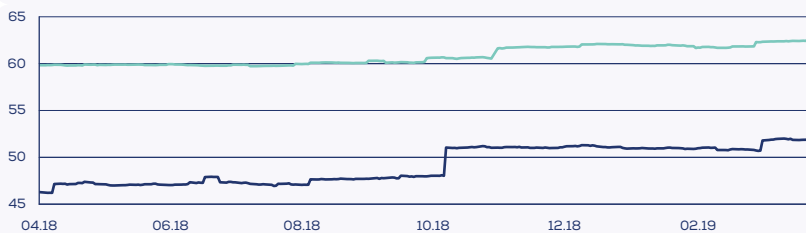
**TOP 10 HOLDINGS (%)**  
29.03.2019

	Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF	S&P 500® Index NR
APPLE INC	4,76	3,60
PROCTER & GAMBLE CO/THE	4,61	1,10
MICROSOFT CORP	4,61	3,83
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,57	1,03
EXXON MOBIL CORP	4,45	1,45
COCA-COLA CO/THE	4,22	0,76
WALT DISNEY CO/THE	4,12	0,82
PEPSICO INC	3,73	0,73
AT&T INC	3,52	0,97
EOG RESOURCES INC	3,46	0,23

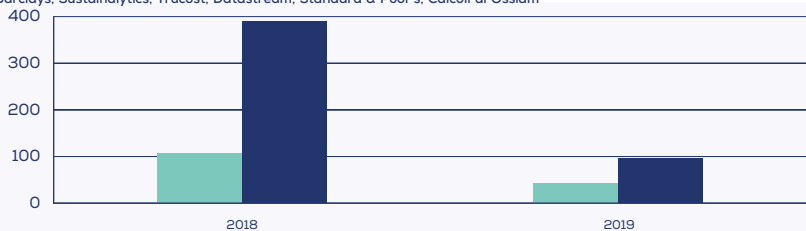
Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

**ESG-SCORES**

— Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)  
— S&P 500® Index NR (EUR)



Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam



**Emissioni di GES in tCO2**  
(29.03.2019)

■ Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)  
■ S&P 500® Index NR (EUR)  
Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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 numero 2011/74085-7020-0-PC dalla Commission de Surveillance du Secteur Financier del Granducato del Lussemburgo il 22 aprile 2011. 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.

Il Fondo Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR) non è in alcun modo sponsorizzato, avallato o promosso da BARCLAYS. BARCLAYS non è in alcun caso responsabile di eventuali errori, omissioni o interruzioni dell'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index. Barclays Bank PLC e le sue controllate e/o consociate ("Barclays") non è l'emittente o il produttore di Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index e Barclays non ha responsabilità, obblighi o doveri nei confronti degli investitori in Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector se non in relazione alla loro distribuzione ai sensi del contratto stipulato con OSSIAM. L'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index è un marchio di proprietà di Barclays Bank PLC o di Barclays Capital Inc., concesso in licenza d'uso a OSSIAM in qualità di Emittente di Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector. Inoltre, OSSIAM di Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector può concludere per conto proprio operazioni con Barclays relative a Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index in relazione a Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector, tuttavia gli investitori acquistano Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector da OSSIAM e gli investitori non acquistano alcuna partecipazione in Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index né stabiliscono un rapporto di qualsiasi natura con Barclays per effetto dell'investimento nell'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index. Il fondo non sono sponsorizzati, supportati, venduti o promossi da Barclays e Barclays non rilascia alcuna dichiarazione o garanzia, espressa o implicita in relazione all'opportunità di investire nell'Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector o con riferimento all'uso di Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index o relativamente a qualsiasi dato ivi contenuto [se non in relazione alla loro distribuzione ai sensi del contratto stipulato con OSSIAM. Barclays non è responsabile nei confronti dell'Emittente, gli investitori o qualsiasi terza parte con riferimento all'uso o all'accuratezza di Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index e/o di qualsiasi dato ivi contenuto.

L'ACCESSO AI PRODOTTI E SERVIZI PRESENTATI IN QUESTA PRESENTAZIONE PUO' ESSERE SOTTOMESSA A RESTRIZIONI PER ALCUNE PERSONE O PAESI, PER VIA DI UN VIETIVO 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.

