

Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)

DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Shiller Barclays CAPE® US Sector Value è un approccio sistematico di tipo Value che si basa sulle ricerche del Professor Robert Shiller. Tale strategia offre un'esposizione al mercato azionario americano attraverso la rotazione settoriale basata sull'indicatore Cyclically Adjusted Price-to-Earnings (CAPE®) per selezionare quei settori potenzialmente sottovalutati. Questa strategia è stata creata per offrire un'esposizione al mercato azionario ad alta capitalizzazione con uno stile Value ed è adatta agli investitori buy-and-hold con un orizzonte temporale pluriennale.

- Esposizione ai titoli americani attraverso un approccio di selezione di settori industriali basato sull'indicatore CAPE®
- Metrica di valutazione ampiamente utilizzata che si basa sui lavori del Professor Shiller
- Un processo di investimento che intende identificare quei settori potenzialmente sottovalutati nel lungo periodo

RENDIMENTO DEL PRODOTTO DAL LANCIO

28.06.2019

— Ossiam Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)
— S&P 500® Index NR (EUR)



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

RENDIMENTI DAL LANCIO

28/06/2019

| | MTD rendimento % | YTD rendimento % | Rendimento 1-anno % | Rendimento annualizzato 3-anno % | Rendimento annualizzato 5-anno % | Rendimento annualizzato dal lancio % |
|--------------------------|------------------|------------------|---------------------|----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|
| Fondo | 4,21 | 19,90 | 13,64 | 15,68 | — | 13,02 |
| Indice | 4,29 | 20,46 | 14,58 | 16,38 | 17,11 | 13,64 |
| Universo di investimento | 4,70 | 18,63 | 11,67 | 13,51 | 14,05 | 10,05 |

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

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO

(28.06.2019)

| | Volatilità % Annualizzato | Alpha % Annualizzato | BETA | Tracking Error % 1-Anno | SHARPE RATIO | MAX DRAWDOWN % |
|--------------------------|---------------------------|----------------------|------|-------------------------|--------------|----------------|
| Fondo | 16,58 | 3,11 | 0,99 | 0,07 | 0,79 | -19,33 |
| Indice | 16,58 | 3,72 | 0,99 | — | 0,82 | -19,21 |
| Universo di investimento | 16,53 | — | — | — | 0,61 | -18,49 |

Ossiam/Bloomberg/Barclays/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 | Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index (USD) |
| Universo di investimento | S&P 500® Index NR (USD) |
| Ticker Bloomberg | BXIIICUSU Index |
| Data di lancio | 05.10.2012 |
| 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 | USD 1.783.848.229 |
| AuM della classe | EUR 485.234.500 |
| Net Asset value | EUR 629.486 |
| Numero di azioni | 770.842 |
| Valuta del fondo | USD |
| Valuta della classe | EUR |
| ISIN | LU1079841273 |
| Data di lancio | 22.06.2015 |
| Metodo di replica | Sintetico |
| Total Expense Ratio | 0,65% |

INFORMAZIONI

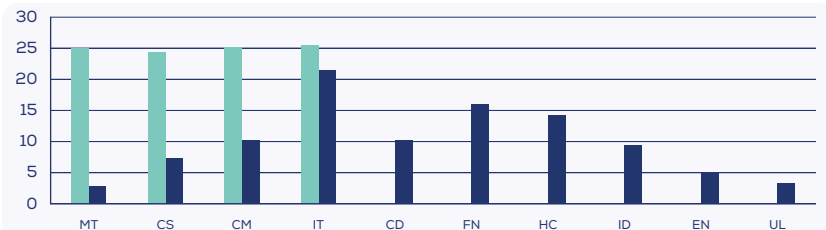
| | |
|--|-----------------------------|
| Cut-off | 16:00 (ora del Lussemburgo) |
| Investimento minimo sur mercato secondario | 1 Azione |
| Borsa Italiana Ticker | |
| Ticker Bloomberg | CAPU IM |

TOP 10 HOLDINGS (%)

28.06.2019

| | Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index | S&P 500® Index NR |
|-------------------------|---|-------------------|
| MICROSOFT CORP | 4,99 | 4,20 |
| FACEBOOK INC-A | 4,92 | 1,90 |
| APPLE INC | 4,20 | 3,54 |
| LINDE PLC | 3,97 | 0,45 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 3,76 | 1,13 |
| ALPHABET INC-CL C | 2,85 | 1,36 |
| ALPHABET INC-CL A | 2,79 | 1,33 |
| COCA-COLA CO/THE | 2,68 | 0,80 |
| PEPSICO INC | 2,52 | 0,75 |
| WALMART INC | 2,12 | 0,63 |

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



RIPARTIZIONE SETTORIALE (28.06.2019)

■ Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index (USD)
 ■ S&P 500® Index NR (USD)
 Ossiam/Bloomberg/Barclays/Standard & Poor's, Calcoli di Ossiam

MT: Materials • CS: Consumer Staples • CD: Consumer Discretionary • FN: Financial and Real Estate • HC: Health Care • ID: Industrials • EN: Energy • CM: Communications Services • IT: Information Technology • UL: Utilities

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.

Il Fondo OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (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 SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR 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 SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR. Inoltre, OSSIAM di OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR può concludere per conto proprio operazioni con Barclays relative a Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index in relazione a OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR, tuttavia gli investitori acquistano OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR 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 SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR 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 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.

