

## 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.

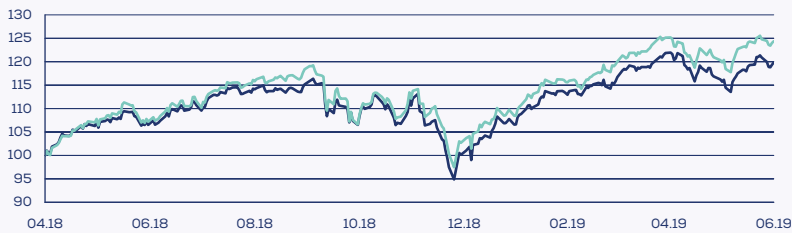
Benefici:

- 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

28.06.2019

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

### 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	4,99	19,94	15,38	—	—	19,93
Universo di investimento	4,70	18,63	11,67	13,51	14,05	16,52

Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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	15,96	3,36	1,00	0,10	1,25	-18,25
Universo di investimento	15,49	—	—	—	1,07	-18,49

Barclays, Sustainalytics, 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
Tipo	ETF gestita attivamente
AuM totale del fondo	USD 49.707.925
AuM della classe	EUR 25.215.962
Net Asset value	EUR 64.856
Numero di azioni	388.800
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	IE00BF92LV92
Data di lancio	05.04.2018
Metodo di replica	Fisica
Total Expense Ratio	0,75%

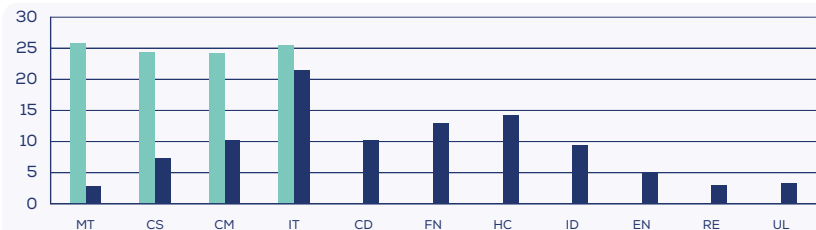
### INFORMAZIONI

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

**TOP 10 HOLDINGS (%)**  
28.06.2019

	Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF	S&P 500® Index NR
APPLE INC	4,68	3,54
LINDE PLC	4,62	0,45
MICROSOFT CORP	4,50	4,20
WALT DISNEY CO/THE	4,46	1,00
PROCTER & GAMBLE CO/THE	4,39	1,13
PEPSICO INC	4,30	0,75
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,24	0,97
ECOLAB INC	3,76	0,21
AT&T INC	3,25	1,00
COCA-COLA CO/THE	3,23	0,80

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



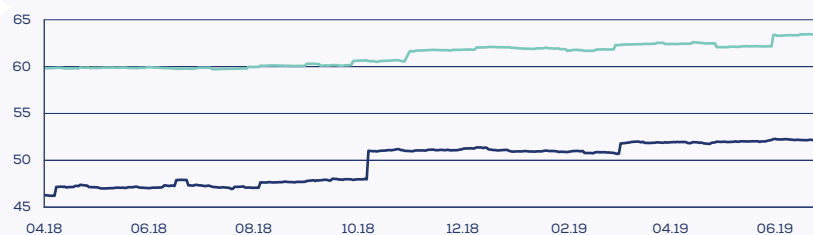
**RIPARTIZIONE SETTORIALE**  
(28.06.2019)

■ 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

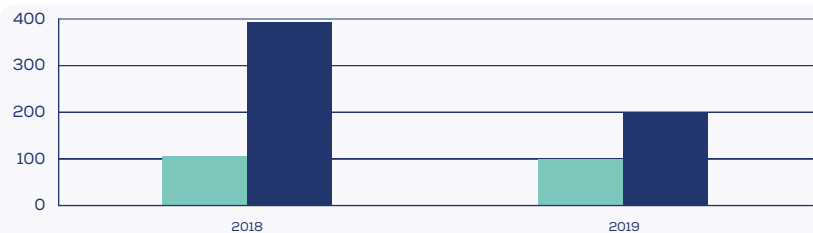
MT: Materials • CS: Consumer Staples • CD: Consumer Discretionary • FN: Financials • HC: Health Care • ID: Industrials • EN: Energy • RE: Real Estate • CM: Communications Services • IT: Information Technology • UL: Utilities

**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**  
(28.06.2019)

■ 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 IRL ICAV ("ICAV") è un fondo multicomparto costituito come società di investimento a capitale variabile di diritto irlandese con responsabilità separata tra i comparti e autorizzato dalla Banca Centrale d'Irlanda con il numero C173953. L'ICAV ha nominato Ossiam come società di gestione, responsabile della gestione finanziaria dei fondi nonché dell'amministrazione e della distribuzione dell'ICAV. Ossiam, filiale di Natixis Investment Managers, è autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers come società di gestione di portafogli con il numero GP-10000016. L'accuratezza, la completezza o l'adeguatezza delle informazioni provenienti da fonti esterne non è garantita, sebbene siano state raccolte da fonti affidabili e rispettabili. Il contenuto di questo documento è stato approvato da Ossiam, una società di gestione regolamentata francese che opera nel Regno Unito con un passaporto UCITS per la commercializzazione. Quando fornito nel Regno Unito, questo documento è distribuito a scopo informativo solo a clienti professionali o controparti qualificate ai fini del Manuale FSA e non può essere considerato o utilizzato da nessun'altra persona.

L'accesso ai prodotti e ai servizi descritti nel presente documento può essere soggetto a restrizioni per quanto riguarda alcuni individui o in alcuni paesi. Nessuno dei prodotti o servizi qui presentati sarà fornito da Ossiam.