

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

DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Shiller Barclays CAPE® Europe 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 europeo 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 europei 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

28.09.2018

— Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)
— MSCI Europe Net Return Index (EUR)



Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, Calcoli di Ossiam

RENDIMENTI DAL LANCIO

28/09/2018

	MTD rendimen- to %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anno %	Rendimento annualizzato 5-anno %	Rendimento annualizzato dal lancio %
Fondo	-0,54	-0,46	-1,41	6,28	—	4,20
Indice	-0,50	-0,06	-0,86	6,96	—	4,91
Universo di investimento	0,53	0,84	1,94	6,96	—	5,90

Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, Calcoli di Ossiam

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO (28.09.2018)

	Volatilità % Annualizzato	Alpha % Annualizzato	BETA	Tracking Error % 1-Anno	SHARPE RATIO	MAX DRAWDOWN %
Fondo	17,02	-1,54	0,97	0,04	0,25	-23,68
Indice	17,02	-0,83	0,97	—	0,29	-23,27
Universo di investi- mento	16,84	—	—	—	0,35	-25,92

Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, 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	Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (EUR)
Universo di investimento	MSCI Europe Net Return Index (EUR)
Ticker Bloomberg	BXICESE Index
Data di lancio	29.08.2013
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 64.698.105
AuM della classe	EUR 64.698.105
Net Asset value	EUR 309.869
Numero di azioni	208.792
Valuta del fondo	EUR
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU1079842321
Data di lancio	30.12.2014
Metodo di replica	Sintetico
Total Expense Ratio	0,65%

INFORMAZIONI

Cut-off	14:45 (ora del Lussemburgo)
Investimento minimo sur mercato secondario	1 Azione
Borsa Italiana Ticker	
Ticker Bloomberg	CAPE IM

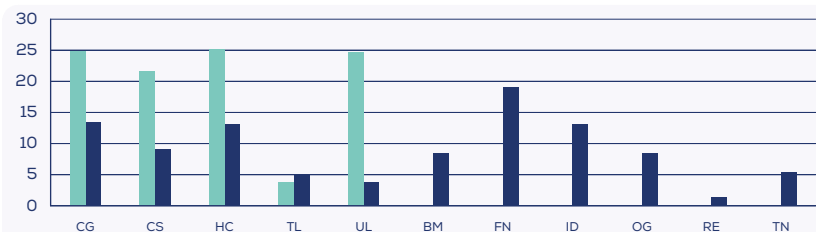
› Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF 1C (EUR)

TOP 10 HOLDINGS (%)

28.09.2018

	Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index	MSCI Europe Net Return Index
NESTLE SA	5,31	2,86
NOVARTIS AG	3,95	2,05
ROCHE HOLDING AG	3,61	1,88
IBERDROLA SA	3,32	0,48
ENEL SPA	3,16	0,46
NATIONAL GRID PLC	2,62	0,38
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,58	1,08
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,18	1,18
SANOFI	2,11	1,10
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,10	1,09

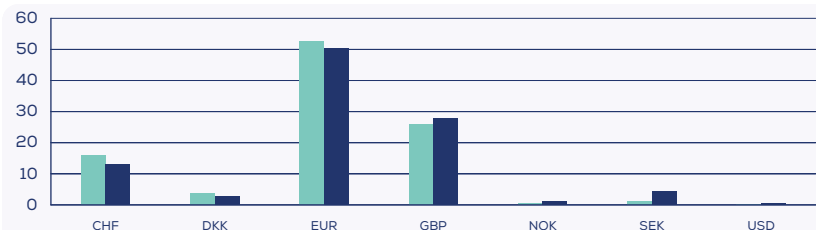
Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, Calcoli di Ossiam



RIPARTIZIONE SETTORIALE (28.09.2018)

■ Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (EUR)
 ■ MSCI Europe Net Return Index (EUR)
 Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, Calcoli di Ossiam

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



RIPARTIZIONE PER VALUTA (28.09.2018)

■ Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index (EUR)
 ■ MSCI Europe Net Return Index (EUR)
 Ossiam/Bloomberg/Barclays/MSCI, Calcoli di Ossiam

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

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® EUROPE 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® Europe 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® Europe Sector Value Net TR Index e Barclays non ha responsabilità, obblighi o doveri nei confronti degli investitori in OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR) se non in relazione alla loro distribuzione ai sensi del contratto stipulato con OSSIAM. L'indice Shiller Barclays CAPE® Europe 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® EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR). Inoltre, l'Emittente di Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR può concludere per conto proprio operazioni con Barclays relative all'Indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR in relazione all'Indice Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR, tuttavia gli investitori acquistano l'Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR da Ossiam Lux e gli investitori non acquistano alcuna partecipazione nell'Indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR né stabiliscono un rapporto di qualsiasi natura con Barclays per effetto di aver investito nell'indice Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR. Ossiam Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR non è sponsorizzato, supportato, venduto o promosso da Barclays se non in relazione alla sua distribuzione ai sensi di un contratto 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® Europe Sector Value Net TR Indexe/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.