

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

DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Minimum Variance ha lo scopo di ridurre la volatilità rispetto ai benchmark ponderati per capitalizzazione di mercato, mantenendo allo stesso tempo un alto livello di diversificazione.

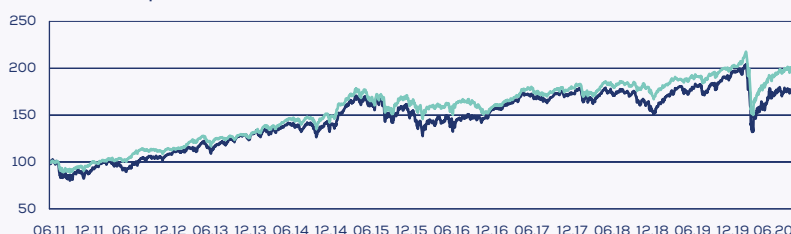
La strategia utilizza stime del rischio dei titoli individuali e le correlazioni così da poter costruire un portafoglio long only con uno stile difensivo.

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 al rischio azionario
- Obiettivo di riduzione della volatilità
- Benefici provenienti dalla cosiddetta anomalia low-volatility

PERFORMANCE (NETTA) DAL LANCIO DEL FONDO

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



Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anni %	Rendimento annualizzato 5-anni %	Rendimento annualizzato dal lancio %
Fondo	0,79	-0,67	2,07	4,30	5,32	7,76
Indice	0,83	-0,52	2,40	4,55	5,61	8,11
Universo di investimento	-1,41	-11,56	-6,15	0,22	3,51	6,07

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità % Annualizzata	Alpha % Annualizzato	Beta	Tracking Error % 1-Anno	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	12,75	3,66	0,67	0,09	0,62	-31,00
Indice	12,76	4,01	0,68	-	0,64	-31,03
Universo di investimento	17,36	-	-	-	0,36	-35,36

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

NOTA BENE: Le performance sono al netto delle commissioni. 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, rischi di controparte e di concentrazione geografica, oltre al rischio di mercato. Per saperne di più sui rischi si prega di far riferimento al documento contenente le informazioni chiave per gli investitori e al Prospetto del fondo prima di investire.

Si prega di notare che se la valuta del fondo/classe di azione è diversa dalla valuta del vostro paese, eventuali perdite o guadagni generati dal fondo/classe di azione possono essere influenzati dalle fluttuazioni del tasso di cambio (sia al rialzo che al ribasso)

INDICATORE SINTETICO DI RISCHIO E RENDIMENTO



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 SULL'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 SUL FONDO

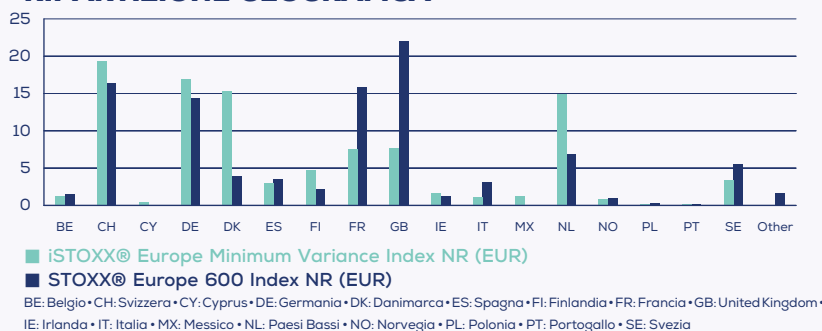
Depositaria	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam Lux SICAV
UCITS	Si
Dividendi	Reinvestiti
AuM totale del fondo	EUR 202.577.116
AuM della classe	EUR 118.130.906
Net Asset value	EUR 193.277
Numero di azioni	611.201
Valuta del fondo	EUR
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU0599612842
Data di lancio	21.06.2011
Metodo di replica	Sintetico
TER	0,65%

INFORMAZIONI

Cut-off ¹	15:30 (ora del Lussemburgo)
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
London Stock Exchange in EUR	EUMV LN
London Stock Exchange in GBP	LEMV LN
XETRA in EUR	OSX4 GY
Euronext Paris in EUR	EUMV FP
SIX Swiss Exchange in EUR	EUMV SW
Borsa Italiana in EUR	EUMV IM

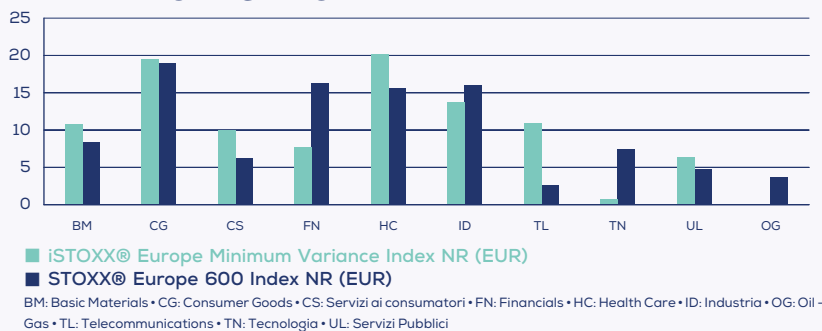
¹Sottoscrizioni sul mercato primario disponibili solo per Partecipanti Autorizzati e investitori approvati.

RIPARTIZIONE GEOGRAFICA



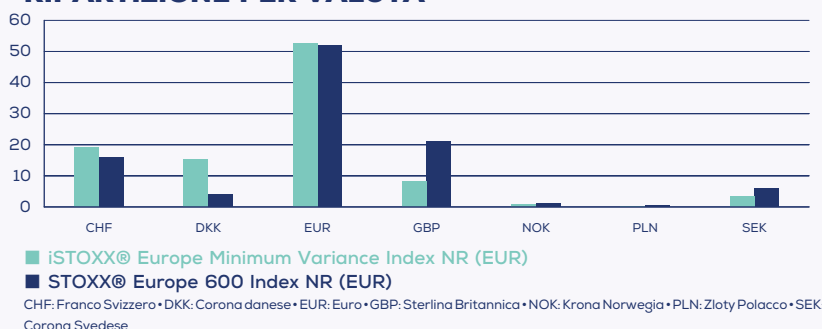
Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

RIPARTIZIONE SETTORIALE



Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

RIPARTIZIONE PER VALUTA



Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

TOP 10 POSIZIONI (%)

	iSTOXX@ Europe Minimum Variance Index NR	STOXX@ Europe 600 Index NR
QIAGEN N.V.	4,72	0,13
SCHINDLER HOLDING AG	3,51	0,12
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	3,39	0,18
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	3,28	0,35
SIG COMBIBLOC GROUP AG	3,24	0,06
KONE OYJ	3,05	0,39
TESCO PLC	2,69	0,29
CHR HANSEN HOLDING A/S	2,64	0,12
SYMRISE AG	2,47	0,19
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,44	0,10

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, STOXX Ltd

CONTATTI/INFORMAZIONI

www.ossiam.com
 mail : info@ossiam.com
 TEL +33 1 84 79 42 70
 80 av. de la Grande Armée
 75017 PARIGI - FRANCIA

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 Bank International GmbH, Luxembourg Branch, 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, è autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers in qualità di società di gestione di portafoglio con il numero GP-10000016.

Per gli investitori in Svizzera: il rappresentante e agente pagatore del fondo in Svizzera è RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Filiale di Zurigo, Bleicherweg 7, 8027 Zurigo.

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 dei dati associati all'OSSIAM iSTOXX@ EUROPE MINIMUM VARIANCE NR; L'accuratezza o la completezza dell'OSSIAM iSTOXX@ EUROPE MINIMUM VARIANCE NR dei dati a questo associati; La commerciabilità e l'idoneità per uno scopo o uso particolare dell'OSSIAM iSTOXX@ EUROPE MINIMUM VARIANCE NR 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 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 QUESTO DOCUMENTO PUO' ESSERE MESSO A RESTRIZIONE 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.

Il presente materiale viene fornito esclusivamente a fini informativi su richiesta di soggetti che prestano servizi di investimento ed altri Clienti Professionali. Questo materiale non deve essere usato con gli investitori Retail. Gli intermediari che prestano servizi di investimento sono responsabili nei confronti dei propri clienti dell'offerta o vendita di fondi o servizi a terzi nel rispetto delle norme applicabili nel relativo Paese.

In Italia Il presente materiale è fornito da Natixis Investment Managers S.A., società di gestione del risparmio, o dagli uffici della sua succursale Natixis Investment Managers S. A., Succursale Italiana, una società iscritta nell'elenco allegato all'Albo delle SGR tenuto dalla Banca d'Italia al n. 23458.3. Natixis Investment Managers S.A. è una società di gestione di diritto lussemburghese autorizzata dalla Commission de Surveillance du Secteur Financier e registrata al numero B 115843. La sede legale di Natixis Investment Managers S.A. è 2 rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg, Granducato del Lussemburgo. La sede legale di Natixis Investment Managers S.A., Succursale Italiana è in Via San Clemente, 1 - 20122 Milano, Italia.

Le società sopra menzionate sono strutture commerciali controllate da Natixis Investment Managers, holding che raggruppa varie società di gestione specializzate e strutture commerciali presenti sul territorio mondiale. Le società di gestione e le strutture commerciali controllate da Natixis Investment Managers svolgono le loro attività regolamentate solo nelle o dalle giurisdizioni in cui sono abilitate ed autorizzate. I prodotti ed i servizi offerti possono quindi non essere disponibili in tutti i Paesi, ovvero per tutti i tipi di investitori. Le informazioni riportate nel presente materiale sono ritenute attendibili da Natixis Investment Managers ; tuttavia non è possibile garantirne precisione, adeguatezza o completezza.

All'interno del presente documento, la presentazione e /o i riferimenti a specifici titoli, settori o mercati non è da intendersi in termini di consulenza su investimenti, sollecitazione o proposta di acquisto o vendita di strumenti finanziari né offerta di servizi finanziari. Prima di ogni investimento, gli investitori devono esaminare con attenzione gli obiettivi di investimento, i rischi, i costi relative a strategie e prodotti. Le analisi, le opinioni, determinati temi di investimento e il processo di investimento descritti in questo documento rappresentano le posizioni del gestore di portafoglio ad una certa data. Tali elementi così come la composizione e le caratteristiche del portafoglio sono soggetti a cambiamento nel tempo. Le evoluzioni future possono non corrispondere alle previsioni formulate nel presente documento.

Il presente materiale non può essere distribuito, pubblicato o riprodotto, in tutto od in parte.

Gli importi riportati si intendono espressi in USD se non diversamente indicato.

Documento ad uso riservato degli investitori professionali di cui è vietata la diffusione tra il pubblico.