

## Ossiam Japan 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.

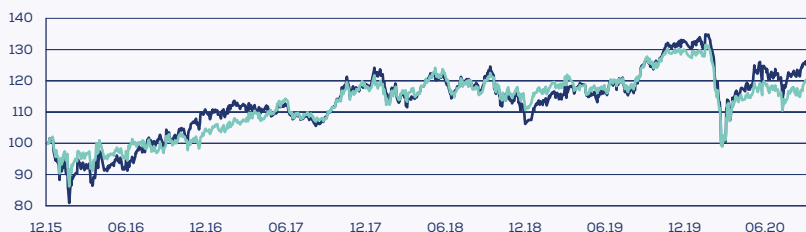
La strategia utilizza stime del rischio dei titoli individuali e le correlazioni così da poter costruire un portafoglio long only con uno stile difensivo.

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 Japan Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)  
— S&P/TOPIX 150 Net TR Index (EUR)



Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Standard & Poor's

### PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anni %	Rendimento annualizzato 5-anni %	Rendimento annualizzato dal lancio %
Fondo	4,10	-6,05	-4,39	3,05	-	3,93
Indice	4,13	-5,79	-3,97	3,64	-	4,63
Universo di investimento	2,56	-4,87	-0,77	4,31	-	4,71

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Standard & Poor's

### PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità % Annualizzata	Alpha % Annualizzato	Beta	Tracking Error % 1-Anno	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	15,76	0,12	0,81	0,17	0,27	-24,75
Indice	15,77	0,82	0,81	-	0,32	-24,70
Universo di investimento	18,26	-	-	-	0,28	-26,41

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Standard & Poor's

**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 ETF 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 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.

La classe denominata in Euro non include strumenti di copertura contro il rischio di cambio.

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	Japan Minimum Variance Index NR (JPY)
Universo di investimento	S&P/TOPIX 150 Net TR Index (JPY)
Ticker Bloomberg	JPMVNR Index
Data di lancio	05.10.2015
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	JPY 1.588.374.765
AuM della classe	EUR 12.835.372
Net Asset value	EUR 103,278
Numero di azioni	124.280
Valuta del fondo	JPY
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU1254453738
Data di lancio	21.12.2015
Metodo di replica	Fisico
TER	0,65%

### INFORMAZIONI

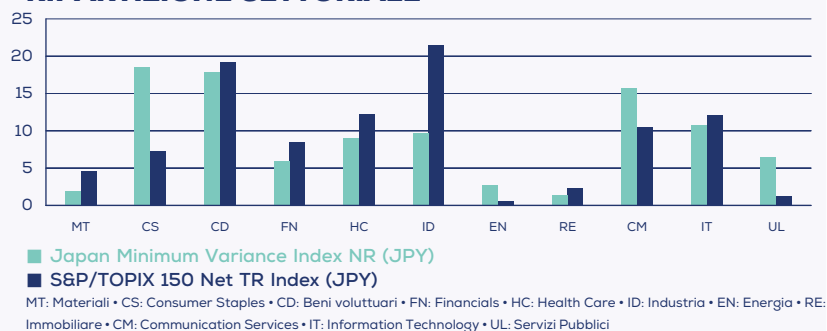
Cut-off<sup>1</sup> 17:00 (ora del Lussemburgo) del giorno di negoziazione precedente

Investimento minimo sul mercato secondario 1 Azione

<sup>1</sup>Sottoscrizioni sul mercato primario disponibili solo per Partecipanti Autorizzati e investitori approvati.

XETRA in EUR	OSXJ GY
Euronext Paris in EUR	JPMV FP
Borsa Italiana in EUR	JPMV IM

## RIPARTIZIONE SETTORIALE



Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Standard & Poor's

## TOP 10 POSIZIONI (%)

	Japan Minimum Variance Index NR	S&P/TOPIX 150 Net TR Index
NTT DOCOMO INC	4,08	1,24
PAN PACIFIC INTERNATIONAL HOLD	3,74	0,44
NINTENDO CO LTD	3,63	2,12
MEIJI HOLDINGS CO LTD	3,41	0,35
NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	2,86	1,53
UNICHARM CORP	2,86	0,62
BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	2,79	0,51
JXTG HOLDINGS INC	2,66	0,36
NISSIN FOODS HOLDINGS CO LTD	2,66	0,25
NITORI HOLDINGS CO LTD	2,63	0,57

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Standard & Poor's

## CONTATTI/INFORMAZIONI

[www.ossiam.com](http://www.ossiam.com)  
 mail : [info@ossiam.com](mailto: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.

OSSIAM ha affidato a S&P Opco LLC, un'affiliata di S&P Dow Jones Indices, il calcolo e la manutenzione di JAPAN MINIMUM VARIANCE INDEX NR e JAPAN MINIMUM VARIANCE EURO HEDGED INDEX NR (gli "Indici"). Gli Indici non sono sponsorizzati da S&P Dow Jones Indices LLC o da sue affiliate o licenziatari terzi, ivi compresi Standard & Poor's Financial Services LLC e Dow Jones Trademark Holdings LLC (collettivamente "S&PDow Jones Indices"). S&P Dow Jones Indices non sarà responsabile per errori od omissioni nel calcolo degli Indici. "Calcolato da S&P Dow Jones Indices" e i relativi marchi stilizzati sono marchi di servizio di S&P Dow Jones Indices e sono stati concessi in licenza per l'uso da parte di OSSIAM. S&P® è un marchio registrato di Standard & Poor's Financial Services LLC, e Dow Jones® è un marchio registrato di Dow Jones Trademark Holdings LLC. S&P DOW JONES INDICES NON GARANTISCE L'ADEGUATEZZA, L'ACCURATEZZA, LA TEMPSTICA E/O LA COMPLETEZZA DEGLI INDICI NÉ DI QUALSIASI DATO IN ESSI CONTENUTO NÉ DI EVENTUALI COMUNICAZIONI COMPRESSE - IN VIA NON LIMITATIVA - COMUNICAZIONI ORALI O SCRITTE (COMPRESSE LE COMUNICAZIONI IN FORMATO ELETTRONICO). S&P DOW JONES INDICES NON SARÀ RESPONSABILE PER DANNI NÉ PERSEGUIBILE PER ERRORI, OMISSIONI O RITARDI RISPETTO A QUANTO SOPRA. S&P DOW JONES INDICES NON FORMULA ALCUNA GARANZIA ESPRESSA O IMPLICITA E RIFIUTA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA DI COMMERCIALIZZABILITÀ O IDONEITÀ PER UNO SCOPO O USO PARTICOLARE O RELATIVAMENTE AI RISULTATI DA OTTENERE DA PARTE DI OSSIAM, DEI PROPRIETARI DEL FONDO O DI QUALSIASI ALTRO SOGGETTO O ENTITÀ IN SEGUITO ALL'USO DEGLI INDICI O ALTRI DATI AD ESSI CORRELATI. SENZA LIMITAZIONE ALCUNA RISPETTO A QUANTO SOPRA, IN NESSUN CASO S&P DOW JONES INDICES SARÀ RESPONSABILE PER DANNI INDIRETTI, SPECIALI, INCIDENTALI, PUNITIVI O CONSEGUENZIALI COMPRESI IN VIA NON LIMITATIVA PERDITA DI PROFITTI, PERDITE COMMERCIALI, PERDITA DI TEMPO O DI CLIENTI, ANCHE QUALORA SIA STATA COMUNICATA LA POSSIBILITÀ DI TALI DANNI IN TERMINI CONTRATTUALI, DI TORTO, RESPONSABILITÀ OGGETTIVA O ALTRO.

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.