

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'indice 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

PERFORMANCE (NETTA) DAL LANCIO DEL FONDO

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



Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's, Solactive AG

PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anni %	Rendimento annualizzato 5-anni %	Rendimento annualizzato al lancio %
Fondo	-0,27	-0,48	4,78	11,81	14,11	11,87
Indice	-0,25	-0,21	5,22	12,54	14,73	12,47
Universo di investimento	-1,93	0,63	6,44	11,90	12,33	10,07

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's, Solactive AG

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità % Annualizzata	Alpha % Annualizzata	Beta	Tracking Error % 1-Anno	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	21,48	1,79	1,00	0,06	0,57	-34,48
Indice	21,49	2,38	1,00	-	0,60	-34,50
Universo di investimento	21,12	-	-	-	0,49	-33,63

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's, Solactive AG

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.

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	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

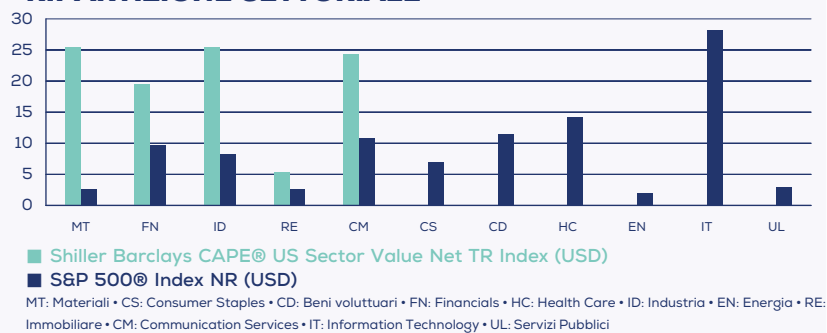
DATI SUL FONDO

Depositaria	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam Lux SICAV
UCITS	Si
Dividendi	Reinvestiti
AuM totale del fondo	USD 1.701.731.780
AuM della classe	EUR 433.026.631
Net Asset value	EUR 695.749
Numero di azioni	622.389
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU1079841273
Data di lancio	22.06.2015
Metodo di replica	Sintetico
TER	0,65%

INFORMAZIONI

Cut-off ¹	16:00 (ora del Lussemburgo)
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
¹ Sottoscrizioni sul mercato primario disponibili solo per Partecipanti Autorizzati e investitori approvati.	
XETRA in EUR	USCP GY
Euronext Paris in EUR	CAPU FP
SIX Swiss Exchange in EUR	CAPU SW
Borsa Italiana in EUR	CAPU IM

RIPARTIZIONE SETTORIALE



Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's, Solactive AG

TOP 10 POSIZIONI (%)

	Shiller Barclays CAPE@ US Sector Value Net TR Index	S&P 500@ Index NR
FACEBOOK INC-A	5,51	2,26
LINDE PLC	4,35	0,45
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,06	1,51
ALPHABET INC-CL A	2,74	1,58
ALPHABET INC-CL C	2,68	1,55
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,29	0,24
JPMORGAN CHASE & CO	2,12	1,05
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,98	0,20
NEWMONT MINING CORP	1,77	0,18
ECOLAB INC	1,72	0,18

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, Standard & Poor's, Solactive AG

CONTATTI/INFORMAZIONI

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

Il Fondo OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE@ US SECTOR VALUE TRUCITS ETF IC (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 TRse 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 TRpuo' 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 TRda 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 TRo con riferimento all'uso di Shiller Barclays CAPE@ US Sector Value Net TR Index or relativamente a qualsiasi dato ivi contenuto [se non in relazione alla loro distribuzione ai sensi del contratto stipulato con OSSIAM. Barclays non e'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 Indexe/o di qualsiasi dato ivi contenuto.

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.