

Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF 1A (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.

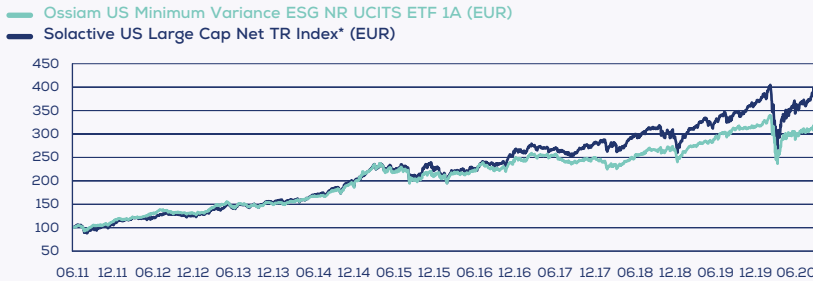
La strategia utilizza stime del rischio dei titoli individuali e le correlazioni così da poter costruire un portafoglio long only con uno stile difensivo.

Il processo di ottimizzazione viene applicato ad una vasta gamma di titoli filtrati attraverso i criteri ESG (mantenendo il 70% dei titoli con il miglior rating 'all'interno di ogni peer group ed escludendo i titoli esposti a controversa grave in base ai livelli di rating di Sustainalytics, agli armamenti controversi e in breach con i principi delle Nazioni Unite Global Compact).

Questo approccio è adatto agli investitori buy-and-hold con un orizzonte temporale pluriennale in cerca di un'esposizione al mercato azionario attraverso titoli conformi ai criteri ESG e con una volatilità decisamente inferiore.

- Esposizione al premio al rischio azionario ma coerente con un approccio ESG
- Obiettivo di riduzione della volatilità
- Benefici provenienti dalla cosiddetta anomalia low-volatility

PERFORMANCE (NETTA) DAL LANCIO DEL FONDO



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

PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anni %	Rendimento annualizzato 5-anni %	Rendimento annualizzato dal lancio %
Fondo	-1,58	-3,62	-3,78	8,33	8,66	12,77
Indice	-1,55	-3,09	-3,08	9,19	9,24	13,18
Universo di investimento	-1,84	2,51	8,41	12,63	12,77	15,37

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

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità % Annualizzata	Alpha % Annualizzato	Beta	Tracking Error % 1-Anno	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	15,24	1,27	0,75	0,13	0,84	-30,43
Indice	15,25	1,68	0,75	-	0,87	-30,34
Universo di investimento	18,86	-	-	-	0,82	-33,65

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

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 legato agli investimenti ESG, 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.
 * L'indice di Riferimento (risp. Il Benchmark) è calcolato utilizzando le performances dell'Ossiam US Minimum Variance NR (risp. S&P 500 Index NR) fino al 16 Giugno 2017 e le performances dell' US ESG Minimum Variance NR Index (risp. Solactive US Large Cap NR Index) in seguito. Questo metodo di calcolo riflette il cambiamento dell'indice di riferimento e del benchmark effettivo per il fondo alla chiusura del mercato del 16 Giugno 2017. Ossiam US Minimum Variance ESG NR UCITS ETF, un comparto di Ossiam IRL ICAV, è stato creato il 24 aprile 2020 dalla fusione per incorporazione di Ossiam US Minimum Variance ESG NR, un comparto di Ossiam Lux SICAV, con un rapporto di 1 per 1. I dati presentati prima del 24 aprile 2020 sono relativi al comparto lussemburghese e presentati a titolo informativo.
 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	US ESG Minimum Variance Index NR * (USD)
Universo di investimento	Solactive US Large Cap Net TR Index* (USD)
Ticker Bloomberg	ESGUSMVN
Data di lancio	09.03.2016
Asset Class	Azioni
Frequenza dei ribilanciamenti	Mensile

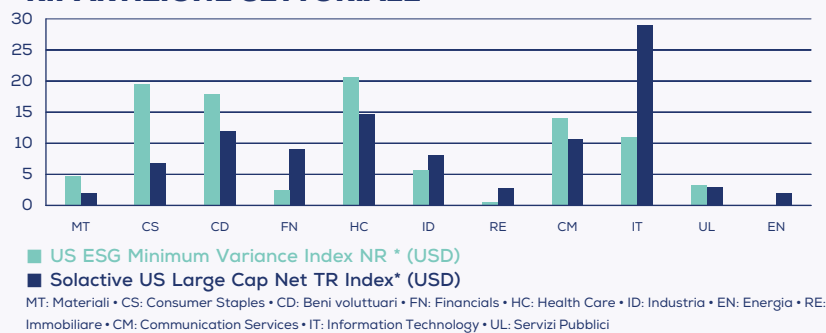
DATI SUL FONDO

Depositaria	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam IRL ICAV
UCITS	Si
Dividendi	Reinvestiti
AuM totale del fondo	USD 206.980.071
AuM della classe	EUR 122.239.127
Net Asset value	EUR 205,075
Numero di azioni	596.071
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	IE00BHNGHX58
Data di lancio	24.04.2020
Metodo di replica	Fisico
TER	0,65%

INFORMAZIONI

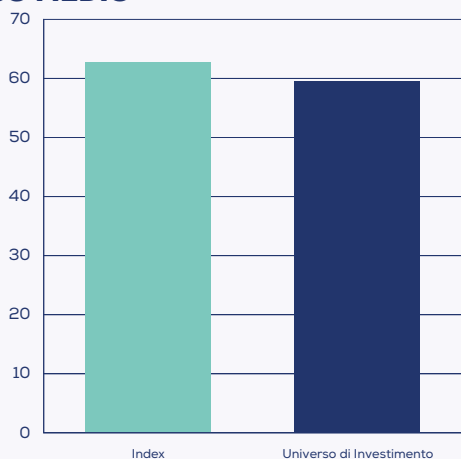
Cut-off ¹	15:00 (orario in Irlanda)
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
¹ Sottoscrizioni sul mercato primario disponibili solo per Partecipanti Autorizzati e investitori approvati.	
XETRA in EUR	OSX2 GY
Euronext Paris in EUR	SPMV FP
SIX Swiss Exchange in EUR	SPMV SW
Borsa Italiana in EUR	SPMV IM

RIPARTIZIONE SETTORIALE



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

RATING ESG MEDIO



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

TOP 10 POSIZIONI (%)

	US ESG Minimum Variance Index NR*	Solactive US Large Cap Net TR Index*	ESG Rating
QIAGEN NV	4,59	0,04	55,90
TIFFANY & CO	4,43	0,05	57,34
NEWMONT MINING CORP	3,73	0,18	77,99
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,63	0,87	76,54
DOLLAR GENERAL CORP	3,35	0,19	50,09
KROGER CO	3,08	0,09	67,85
NORTONLIFELOCK INC	2,84	0,04	66,52
CLOROX COMPANY	2,57	0,09	68,34
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,37	0,48	68,25
CHARTER COMMUNICATIONS INC	2,24	0,32	45,83

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

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 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.

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.

Lo strumento finanziario non è sponsorizzato, promosso, venduto o supportato in alcun altro modo da Solactive AG e la stessa non offre in qualsiasi momento o in qualsiasi altro modo una garanzia o assicurazione implicita o espressa in merito ai risultati dell'utilizzo dell'Indice e/o del Marchio dell'Indice o del Prezzo dell'Indice. L'Indice è calcolato e pubblicato da Solactive AG. Solactive AG si impegna a garantire il corretto calcolo dell'Indice. A prescindere dai propri obblighi nei confronti dell'Emittente, Solactive AG non è tenuta a segnalare gli errori dell'Indice a terzi compresi, a titolo meramente esemplificativo e non esaustivo, gli investitori e/o gli intermediari finanziari dello strumento finanziario. Né la pubblicazione dell'Indice da parte di Solactive AG né la concessione in licenza dell'Indice o del Marchio dell'Indice ai fini dell'utilizzo in relazione allo strumento finanziario costituiscono una raccomandazione da parte di Solactive AG di investire capitale in tale strumento finanziario, né costituiscono in alcun modo una garanzia o un'opinione di Solactive AG in merito a qualsiasi investimento nel presente strumento finanziario.

L'accesso ai prodotti e servizi presentati in questo documento può essere messo a restrizione per alcune persone o paesi, per via di un divieto generale o in virtù 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.