

## Ossiam Emerging Markets Minimum Variance NR UCITS ETF 1C (EUR)

### DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

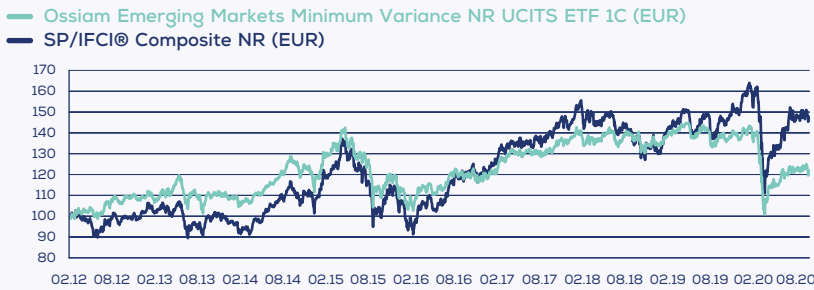
La strategia Minimum Variance ha lo scopo di ridurre la volatilità rispetto ai benchmark ponderati per capitalizzazione di mercato, mantenendo allo stesso tempo un alto livello di diversificazione.

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



Dati calcolati da Ossiam al 29.09.2020. 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	-1,08	-14,42	-14,00	-2,78	1,63	2,17
Indice	-0,92	-13,24	-12,39	-1,08	3,36	3,92
Universo di investimento	-0,85	-7,51	0,01	1,77	7,53	4,46

Dati calcolati da Ossiam al 29.09.2020. 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	13,33	2,14	0,01	0,08	0,18	-30,36
Indice	13,34	3,89	0,01	-	0,31	-29,53
Universo di investimento	147,71	-	-	-	0,03	-82,55

Dati calcolati da Ossiam al 29.09.2020. 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 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 rischio paesi emergenti, 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	Ossiam Emerging Markets Minimum Variance Index NR (USD)
Universo di investimento	SP/IFCI® Composite NR (USD)
Ticker Bloomberg	OEMMVNR Index
Data di lancio	24.01.2012
Asset Class	Azioni
Frequenza dei ribilanciamenti	Semestrale

### 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 110.567.432
AuM della classe	EUR 89.823.754
Net Asset value	EUR 96.021
Numero di azioni	935.460
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU0705291903
Data di lancio	03.02.2012
Metodo di replica	Sintetico
TER	0,75%

### INFORMAZIONI

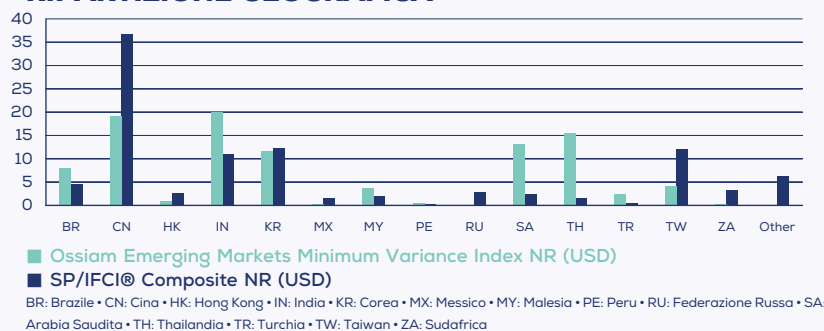
Cut-off<sup>1</sup> 16:00 (ora del Lussemburgo) del giorno di negoziazione precedente

Investimento minimo sul mercato secondario 1 Azione

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

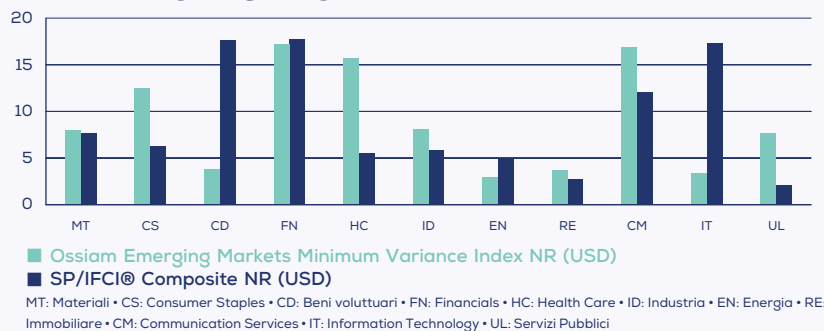
XETRA in EUR	OSX9 GR
Euronext Paris in EUR	EMMV FP
SIX Swiss Exchange in EUR	EMMV SW
Borsa Italiana in EUR	EMMV IM

## RIPARTIZIONE GEOGRAFICA



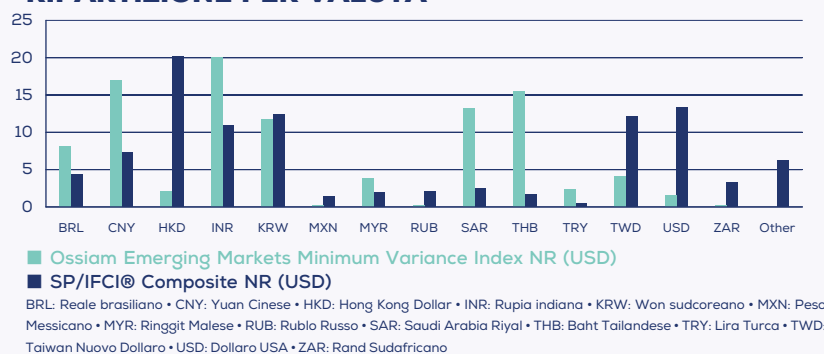
Dati calcolati da Ossiäm al 29.09.2020. Fonte: Ossiäm, Bloomberg, Standard & Poor's

## RIPARTIZIONE SETTORIALE



Dati calcolati da Ossiäm al 29.09.2020. Fonte: Ossiäm, Standard & Poor's

## RIPARTIZIONE PER VALUTA



Dati calcolati da Ossiäm al 29.09.2020. Fonte: Ossiäm, Standard & Poor's

## TOP 10 POSIZIONI (%)

	Ossiäm Emerging Markets Minimum Variance Index NR	SP/IFCI® Composite NR
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVEL	3,12	0,02
SAUDI TELECOM CO	3,01	0,20
ALINMA BANK	2,70	0,05
ADVANCED INFO SERVICE PCL	2,57	0,07
AL RAJHI BANK	2,50	0,27
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,32	0,18
CP ALL PCL	2,26	0,11
SEEGENE INC	2,15	0,06
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL	1,96	0,06
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	1,87	0,27

Dati calcolati da Ossiäm al 29.09.2020. Fonte: Ossiäm, Standard & Poor's

## 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.**

Ossiäm 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 Ossiäm 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. Ossiäm, 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.

L'OSSIÄM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR non è sponsorizzato, approvato, venduto né promosso da Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"), da sue affiliate o licenziatari terzi. Né S&P, né le sue affiliate né tantomeno eventuali licenziatari terzi potranno offrire informazioni o garanzie - espresse o implicite - ai detentori dell'OSSIÄM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR o a chiunque altro in merito all'opportunità di investire in titoli in generale o nell'OSSIÄM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR in particolare né in merito alla capacità dell'Ossiäm Emerging Markets Minimum Variance Index Net Return USD ("l'Indice") di ottenere performance generali sul mercato azionario. L'unico rapporto di S&P e dei licenziatari terzi con Ossiäm consiste nella concessione in licenza di alcuni marchi, marchi di servizio e nomi commerciali di S&P e/o dei suoi licenziatari terzi e nella fornitura di servizi di calcolo e manutenzione associati all'Indice. Né S&P, né le sue affiliate o i licenziatari terzi saranno responsabili o parteciperanno alla determinazione dei prezzi e degli importi dell'OSSIÄM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR né avranno voce sui tempi di emissione o vendita dell'OSSIÄM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR né sulla determinazione o sul calcolo dell'equazione con la quale l'OSSIÄM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR viene convertito in denaro liquido. S&P non avrà alcun obbligo o responsabilità in termini di amministrazione, promozione o negoziazione dell'OSSIÄM EMERGING MARKETS MINIMUM VARIANCE NR. 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, OSSIÄM 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 OSSIÄM 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.