

Ossiam World ESG Machine Learning UCITS ETF 1A (EUR)

DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

L'Ossiam World ESG Machine Learning UCITS ETF mira a fornire il rendimento netto totale di una selezione di azioni dai mercati globali sviluppati utilizzando un algoritmo di machine-learning che identifica i collegamenti tra il profilo ESG (Ambiente, Sociale, Governance) dell'azienda e la performance finanziaria. La selezione dei titoli viene rivalutata nel tempo man mano che l'algoritmo impara dalle nuove informazioni ESG.

Il processo di investimento del fondo è sistematico. In primo luogo, applica un filtro ESG multiplo eliminando le società:

- coinvolte nelle controverse industrie delle armi, del tabacco o del carbone;
- che sono oggetto di gravi controversie in materia di ESG;
- in violazione dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite;
- nella lista di esclusione della Norges Bank Investment Management.

I titoli rimanenti vengono poi analizzati dall'algoritmo di machine learning di Ossiam e classificati come opportunità o rischi finanziari in base al loro profilo ESG.

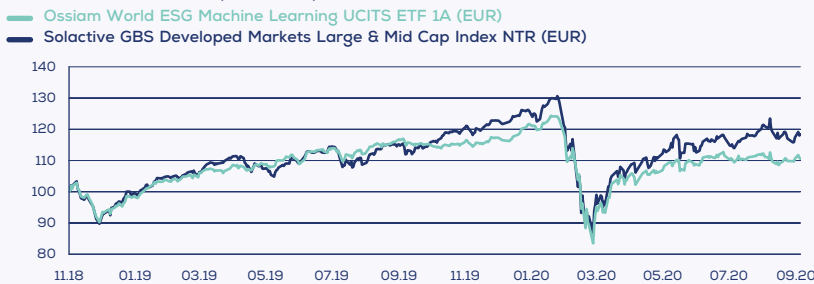
Il portafoglio è costituito da titoli identificati come opportunità e ponderati per ridurre al minimo la volatilità e per raggiungere gli obiettivi ESG del fondo.

Il punteggio ESG del portafoglio dovrebbe essere superiore del 10% rispetto a quello del benchmark di riferimento con una riduzione sostanziale dell'impronta al carbonio (riduzione del 40% del totale delle emissioni di gas a effetto serra), una minore intensità carbonio (emissioni totali di gas serra/ricavi aziendali) e meno emissioni dalle riserve di combustibili fossili.

Vantaggi:

- Uso del machine-learning per rilevare opportunità finanziarie nei dati ESG
- Profilo di rischio/rendimento migliorato
- Miglioramento del profilo ESG con una significativa riduzione dell'impronta al carbonio

PERFORMANCE (NETTA) DAL LANCIO DEL FONDO



Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anni %	Rendimento annualizzato 5-anni %	Rendimento annualizzato dal lancio %
Fondo	-0,40	-5,10	-5,50	-	-	5,58
Universo di investimento	-1,60	-2,72	2,54	-	-	9,60

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità % Annualizzata	Alpha % Annualizzato	Beta	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	19,15	-1,72	0,76	0,31	-32,86
Universo di investimento	23,19	-	-	0,43	-33,64

Dati calcolati da Ossiam al 30.09.2020. Fonte: Ossiam, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

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 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

Universo di investimento	Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap Index NTR (EUR)
Ticker Bloomberg	SDMLMCUN Index
Data di lancio	08.05.2017
Asset Class	Azioni
Frequenza dei ribilanciamenti	Trimestrale

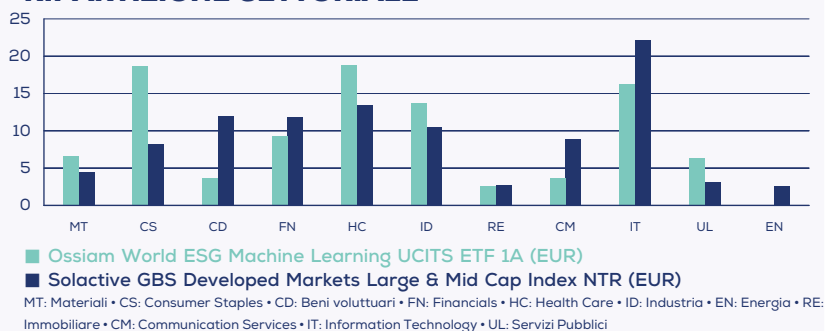
DATI SUL FONDO

Depositaria	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam IRL ICAV
UCITS	Si
Dividendi	Reinvestiti
Tipo	ETF gestito attivamente
AuM totale del fondo	USD 90.245.595
AuM della classe	EUR 39.403.267
Net Asset value	EUR 110.531
Numero di azioni	356.491
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	IE00BF4Q063
Data di lancio	26.11.2018
Metodo di replica	Fisica
TER	0,65%

INFORMAZIONI

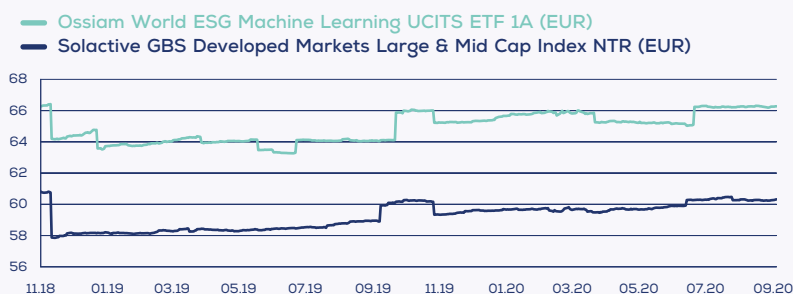
Cut-off ¹	16:00 (orario in Irlanda) del giorno di negoziazione
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
² Sottoscrizioni sul mercato primario disponibili solo per Partecipanti Autorizzati e investitori approvati.	
XETRA in EUR	OWLE GY
SIX Swiss Exchange in EUR	OWLE SW
Borsa Italiana in EUR	OWLE IM

RIPARTIZIONE SETTORIALE



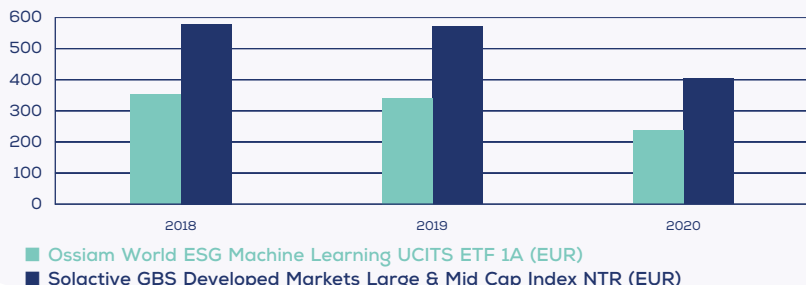
Dati calcolati da OssiAm al 30.09.2020. Fonte: OssiAm, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

ESG-SCORES*



Dati calcolati da OssiAm al 30.09.2020. Fonte: OssiAm, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream
 *L'ESG score (punteggio ESG) è una media ponderata dell'ESG score di ciascun costituente dell'indice.

Emissioni di GES in tCO2 **



Dati calcolati da OssiAm al 30.09.2020. Fonte: OssiAm, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream
 **Le emissioni GES (Gas Effetto Serra) sono le emissioni di CO2 in tonnellate equivalenti ad un investimento di 1 milione di dollari nell'indice.

TOP 10 POSIZIONI (%)

	OssiAm World ESG Machine Learning UCITS ETF	Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap Index NTR
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,64	0,04
KROGER CO	2,36	0,06
MTR CORP LTD	2,27	0,02
LION CORP	2,23	0,01
CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	1,95	0,06
KELLOGG CO	1,94	0,04
GILEAD SCIENCES INC	1,81	0,18
NEWMONT MINING CORP	1,81	0,12
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,79	0,05
MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	1,78	0,03

Dati calcolati da OssiAm al 30.09.2020. Fonte: OssiAm, Solactive, Sustainalytics, Trucost, Datastream

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.

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.