

Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)

DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector mira a realizzare un profilo di rischio/rendimento simile a quello dell'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Index, ma con un'impronta carbonio significativamente ridotta ed un profilo ESG migliorato.

La strategia Shiller Barclays CAPE® US Sector Value è una strategia sistematica di tipo Value basata sulle ricerche del professor Robert Shiller. La strategia offre un'esposizione azionaria al mercato statunitense attraverso un approccio di selezione settoriale basato sul criterio del prezzo/utile (CAPE @ Cyclically Adjusted Price to Earnings) al fine di selezionare settori potenzialmente sottovalutati. La strategia è stata progettata per offrire un'esposizione al mercato azionario a grande capitalizzazione con una distorsione di tipo Value per degli investitori buy-and-hold con orizzonte temporale pluriennale.

Miglioramento del profilo ESG: la strategia esclude le società coinvolte nelle armi controverse, nel tabacco, carbone e le controversie di natura ambientale, sociale e di governance.

Impronta al carbonio ridotta: la strategia, rispetto al suo indice originale, mira a ridurre del 40% le emissioni totali di gas a effetto serra (GES), l'intensità carbonio (GES /fatturato) e le emissioni GES derivanti dalle riserve di combustibili fossili.

Benefici:

- Esposizione ai titoli azionari statunitensi attraverso un approccio di selezione settoriale basato sul rapporto CAPE®.
- Una metrica di valutazione ampiamente diffusa basata sui lavori del Professor Shiller.
- Un processo di investimento che cerca di identificare settori potenzialmente sottovalutati nel lungo termine.
- Un approccio che combina i filtri ESG con la riduzione delle emissioni di gas ad effetto serra.

PERFORMANCE (NETTA) DAL LANCIO DEL FONDO

Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF 1A (EUR)
S&P 500® Index NR (EUR)



Dati calcolati da Ossiam al 30.07.2021. Fonte: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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	1,06	18,13	37,44	19,20	-	20,88
Universo di investimento	2,35	21,44	36,14	17,19	15,30	18,90

Dati calcolati da Ossiam al 30.07.2021. Fonte: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità % Annualizzata	Alpha % Annualizzata	Beta	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	22,98	2,28	0,98	0,93	-32,83
Universo di investimento	22,74	-	-	0,85	-33,63

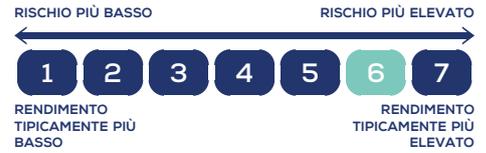
Dati calcolati da Ossiam al 30.07.2021. Fonte: Ossiam, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

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 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. L'indice di riferimento non è destinato ad essere allineato alle ambizioni ambientali o sociali quali promosse dal Fondo. Il Fondo promuove criteri ambientali o sociali e di governance (ESG), ma non ha come obiettivo un investimento sostenibile. Potrà investire in parte in attività con un obiettivo sostenibile, quali definite dalla classificazione dell'UE. 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	S&P 500® Index NR (EUR)
Ticker Bloomberg	SPTR500N Index
Data di lancio	31.12.1998
Asset Class	Azioni
Frequenza dei ribilanciamenti	Mensile

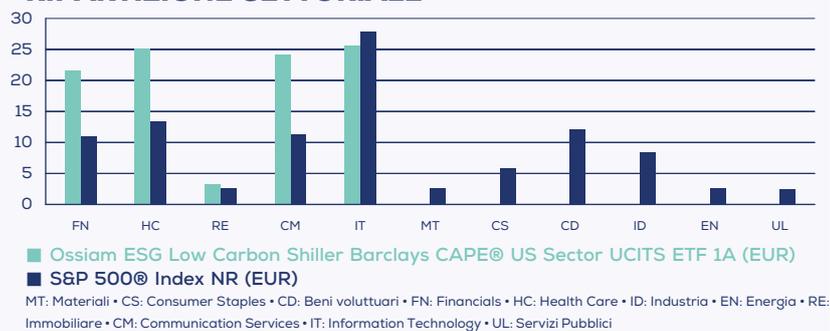
DATI SUL FONDO

Depositaria	The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam IRL ICAV
UCITS	Si
Classificazione SFDR	Article 8
Dividendi	Reinvestiti
Tipo	ETF gestito attivamente
AuM totale del fondo	USD 567.425.236
AuM della classe	EUR 262.146.727
Net Asset value	EUR 97.357
Numero di azioni	2.692.631
Valuta del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	IE00BF92LV92
Data di lancio	05.04.2018
Metodo di replica	Fisica
TER	0,75%

INFORMAZIONI

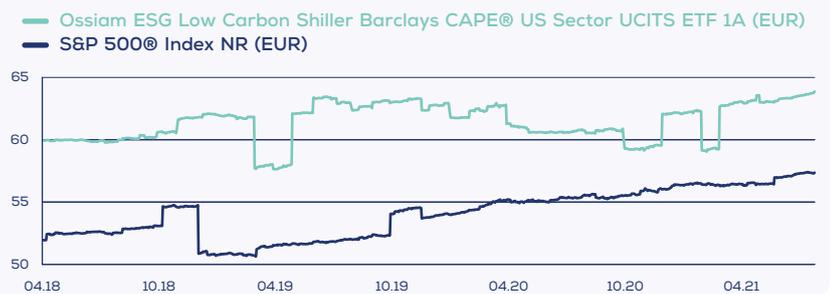
Cut-off ¹	15:00 (orario in Irlanda) del giorno di negoziazione
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione
¹ Sottoscrizioni sul mercato primario disponibili solo per Partecipanti Autorizzati e investitori approvati.	
XETRA in EUR	SHEE GY
Borsa Italiana in EUR	SHEE IM

RIPARTIZIONE SETTORIALE



Dati calcolati da Ossia al 30.07.2021. Fonte: Ossia, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

ESG-SCORES*



Dati calcolati da Ossia al 30.07.2021. Fonte: Ossia, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

*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 Ossia al 30.07.2021. Fonte: Ossia, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, Standard & Poor's

**Le emissioni GES (Gas Effetto Serra) sono le emissioni di CO2 in tonnellate equivalenti ad un investimento di 1 milione di dollari nell'indice.

Il presente documento è un documento a carattere puramente commerciale e in nessun modo un documento a carattere regolamentare.

Ossia 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 Ossia come società di gestione, responsabile della gestione finanziaria dei fondi nonché dell'amministrazione e della distribuzione dell'ICAV. Ossia, 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, la completezza e 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 Ossia, 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 FCA e non può essere considerato o utilizzato da nessun'altra persona.

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, ossia 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 ossia non ha chiesto l'autorizzazione alla commercializzazione.

Il KIID in italiano, così come il prospetto in inglese, sono disponibili gratuitamente sul nostro sito www.ossiam.com

Investimenti ESG - Limiti metodologici: Utilizzando criteri ESG nella politica di investimento, l'obiettivo del Fondo interessato è in particolare quello di gestire meglio il rischio di sostenibilità. I criteri ESG possono essere generati utilizzando modelli proprietari, modelli e dati di terzi o una combinazione di entrambi. I criteri di valutazione possono variare nel tempo o variare a seconda del settore o dell'industria in cui opera l'emittente interessato. L'applicazione di criteri ESG al processo di investimento può indurre il Gestore finanziario a investire o escludere titoli per ragioni non finanziarie, indipendentemente dalle opportunità di mercato disponibili. I dati ESG ricevuti da terzi possono essere incompleti, inaccurati o non disponibili di tanto in tanto. Di conseguenza, esiste il rischio che il GEFIA FINANZIARIO valuti erroneamente un titolo o un emittente, con conseguente inclusione o esclusione, diretta o indiretta, non corretta di un titolo nel portafoglio di un Fondo.

Rischio di sostenibilità: Il Fondo è soggetto a rischi di sostenibilità quali definiti all'articolo 2(22) del regolamento (UE) 2019/2088, a causa di un evento o di una situazione in campo ambientale, sociale o di governance che, se si verifica, potrebbe avere un impatto negativo significativo, reale o potenziale, sul valore dell'investimento. Per ulteriori informazioni sul dispositivo per l'integrazione del rischio di sostenibilità si prega di fare riferimento al sito web della Società di gestione e del gestore finanziario.

La politica di voto e di impegno è disponibile tramite il seguente link: www.ossiam.com

Per ulteriori informazioni sulla metodologia di valutazione ESG del fondo, consultare il prospetto del fondo e il sito web aziendale del gestore degli investimenti delegato.

Barclays Bank PLC e le sue società controllate e/o consociate ("Barclays") non sono emittenti o produttori di Ossia Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF, Ossia Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value TR UCITS ETF o Ossia ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF (insieme, i "Prodotti") e Barclays non si assume responsabilità, obblighi o doveri nei confronti di coloro che investono nei Prodotti, eccezione fatta in relazione alla loro distribuzione ai sensi del contratto con Ossia. L'indice Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR e l'indice Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR (insieme, gli "Indici") sono marchi registrati di proprietà, o concessi in licenza d'uso, di Barclays Bank PLC e sono concessi in licenza d'uso ad Ossia Lux e/o Ossia IRL in qualità di "Emittente(i)" dei Prodotti. Mentre Ossia Lux e/o Ossia IRL, in qualità di Emittenti dei Prodotti, e per loro proprio conto, pongono in essere operazioni con Barclays aventi ad oggetto, o relative agli Indici, in connessione con i Prodotti, gli investitori acquistano i Prodotti da Ossia Lux e/o Ossia IRL e gli investitori non acquisiscono alcun diritto sugli Indici o stabiliscono rapporti di nessun genere con Barclays sulla base dell'investimento nei Prodotti. I Prodotti non sono sponsorizzati o avallati da Barclays e Barclays non fornisce alcuna dichiarazione circa l'idoneità o opportunità dei Prodotti o all'uso degli Indici o alcuno dei dati ivi inclusi, eccezione fatta in connessione con la loro distribuzione ai sensi del contratto con Ossia. Barclays non si assume alcuna responsabilità nei confronti dell'Emittente, gli investitori o terze parti con riferimento all'uso o all'accuratezza degli Indici o dei dati ivi inclusi.

Gli indici Shiller Barclays sono stati sviluppati in parte da RSBB-I, LLC, il cui direttore della ricerca è Robert J. Shiller. RSBB-I, LLC non è un consulente per gli investimenti e non garantisce l'accuratezza o la completezza degli indici Shiller Barclays, o qualsiasi dato o metodologia ivi inclusi o su cui si basano. Né RSBB-I, LLC, né Robert J. Shiller e il suo consulente, IndexVestLAB, LLC e i suoi consulenti, non avranno alcuna responsabilità per eventuali errori, omissioni o interruzioni ivi contenuti e non forniscono alcuna garanzia, esplicita o implicita, in

TOP 10 POSIZIONI (%)

	Ossia ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF	S&P 500® Index NR
APPLE INC	4,76	6,15
MICROSOFT CORP	4,67	5,77
UNITEDHEALTH GROUP INC	4,23	1,05
VISA INC-CLASS A SHARES	3,96	1,12
CHARTER COMMUNICATIONS INC	3,75	0,28
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,64	0,62
CERNER CORP	3,37	0,07
ADOBE SYSTEMS INC	3,17	0,80
ACTIVISION BLIZZARD INC	3,12	0,17
BANK OF AMERICA CORP	2,98	0,78

Dati calcolati da Ossia al 30.07.2021. Fonte: Ossia, Barclays, Sustainalytics, Trucost, Datastream, 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

merito alle prestazioni o ai risultati subiti da qualsiasi parte dell'uso di qualsiasi informazione inclusi o su cui si basano gli indici, e declina espressamente qualsiasi garanzia di commerciabilità o idoneità per uno scopo particolare a tale riguardo, e non sarà responsabile per qualsiasi reclamo o perdita di qualsiasi tipo in relazione all'uso di tali informazioni, incluso ma non limitato a, perdita di profitti o danni punitivi o consequenziali, anche se RSBB-I, LLC o qualsiasi altra parte viene a conoscenza della possibilità dello stesso.

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.

In Brasile: i prodotti potrebbero non essere offerti o venduti al pubblico in Brasile. Di conseguenza, i prodotti non sono stati e non saranno registrati presso la Brazilian Securities and Exchange Commission (Comissão de Valores Mobiliários, il "CVM"), né sono stati presentati all'agenzia precedente per l'approvazione. I documenti relativi ai prodotti, così come le informazioni in essi contenute, non possono essere forniti al pubblico in Brasile, poiché l'offerta di prodotti non è un'offerta pubblica di prodotti in Brasile, né utilizzata in relazione ad alcuna offerta di abbonamento o vendita di prodotti al pubblico in Brasile. Un venditore dei prodotti può essere richiesto dall'acquirente di conformarsi ai requisiti procedurali per dimostrare la precedente titolarità dei prodotti e può essere soggetto all'imposta brasiliana sulle plusvalenze che possono essere trattenute dal prezzo di vendita. Le persone che desiderano offrire o acquistare i prodotti in Brasile dovrebbero consultare il proprio consulente in merito all'applicabilità di questi requisiti di registrazione o di eventuali esenzioni da essi.

In Perù: questi prodotti non sono stati registrati presso la Superintendencia del Mercado de Valores (SMV). La SMV non ha esaminato le informazioni fornite all'investitore. Questo documento è solo per l'uso esclusivo dei clienti istituzionali in Perù e non è per la distribuzione pubblica. Inoltre, i prodotti non sono soggetti alla supervisione della Sovrintendenza bancaria, assicurativa e dei fondi pensione (SBS).

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.