

## Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity Ex Grains TR UCITS ETF 1C (EUR)

### DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Risk Weighted Enhanced Commodity è un approccio sistematico "long-only" che tende ad offrire un'esposizione alle materie prime con una volatilità ridotta rispetto all'universo di investimento. Rispetto agli indici standard, fortemente concentrati ed esposti al rischio di contango, la strategia Risk Weighted Enhanced Commodity combina una efficiente allocazione dei rischi a tecniche di ottimizzazione del roll dei contratti futures al fine di limitarne gli effetti negativi.

- Esposizione all'universo delle materie prime, cereali esclusi
- Riduzione del rischio
- Diversificazione ed ottimizzazione del roll.

### PERFORMANCE (NETTA) DAL LANCIO DEL FONDO

Ossiam Risk Weighted Enhanced Commodity Ex Grains TR UCITS ETF 1C (EUR)  
S&P GSCI® Index (EUR)



Dati calcolati da Ossiam al 30.07.2021. Fonte: Ossiam, Standard & Poor's

### PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento annualizzato 3-anni %	Rendimento annualizzato 5-anni %	Rendimento annualizzato al lancio %
Fondo	3,15	23,49	32,56	5,24	4,43	2,01
Indice	3,20	23,94	33,37	5,83	4,92	2,58
Universo di investimento	1,58	37,72	54,11	-1,76	2,90	-6,22

Dati calcolati da Ossiam al 30.07.2021. 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	11,72	4,68	0,43	0,02	0,19	-28,43
Indice	11,73	5,26	0,43	-	0,24	-27,00
Universo di investimento	22,29	-	-	-	-0,27	-70,16

Dati calcolati da Ossiam al 30.07.2021. 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, materie prime, derivati e di controparte, 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

RISCHIO PIÙ BASSO

RISCHIO PIÙ ELEVATO



RENDIMENTO TIPICAMENTE PIÙ BASSO

RENDIMENTO TIPICAMENTE PIÙ ELEVATO

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 Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR (USD)

Universo di investimento S&P GSCI® Index (USD)

Ticker Bloomberg OCMDRWT Index

Data di lancio 25.02.2013

Asset Class Materie Prime

Frequenza dei ribilanciamenti Mensile

### DATI SUL FONDO

State Street Bank International  
Depositaria GmbH, Luxembourg Branch

Compartimento della  
Forma giuridica Ossiam Lux SICAV

UCITS Si

Classificazione SFDR Article 6

Dividendi Reinvestiti

AuM totale del fondo USD 11.012.291

AuM della classe EUR 7.189.933

Net Asset value EUR 82.881

Numero di azioni 86.750

Valuta del fondo USD

Valuta della classe EUR

ISIN LU0876440578

Data di lancio 05.07.2013

Metodo di replica Sintetico

TER 0,45%

### INFORMAZIONI

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

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 OSXC GY

Euronext Paris in EUR CRWE FP

SIX Swiss Exchange in EUR CRWE SW

Borsa Italiana in EUR CRWE IM

## ALLOCAZIONE SU MATERIE PRIME



Dati calcolati da Ossiam al 30.07.2021. Fonte: Ossiam, Standard & Poor's

## TOP 10 POSIZIONI (%)

Posizione	Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index TR
S&P GSCI LIVE CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	8,02
S&P GSCI ALUMINUM DYNAMIC ROLL INDEX ER	6,82
S&P GSCI FEEDER CATTLE DYNAMIC ROLL INDEX ER	6,51
S&P GSCI GOLD DYNAMIC ROLL INDEX ER	6,36
S&P GSCI COPPER DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,54
S&P GSCI LEAD DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,53
S&P GSCI COTTON DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,50
S&P GSCI NATURAL GAS DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,41
S&P GSCI ZINC DYNAMIC ROLL INDEX ER	5,34
S&P GSCI SUGAR DYNAMIC ROLL INDEX ER	4,85
S&P GSCI® Index	
S&P GSCI CRUDE OIL INDEX TR	34,49
S&P GSCI COPPER INDEX TR	19,69
S&P GSCI GOLD INDEX TR	15,32
S&P GSCI BRENT CRUDE INDEX TR	12,23
S&P GSCI ALLUMINUM T RET	4,34
S&P GSCI GASOIL INDEX TR	3,70
S&P GSCI NATURAL GAS INDEX TR	3,31
S&P GSCI SILVER INDEX TR	2,53
S&P GSCI ZINC INDEX TR	1,09
S&P GSCI NICKEL INDEX TR	0,94

Dati calcolati da Ossiam al 30.07.2021. Fonte: Ossiam, 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.**

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-1000016.

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 KIID in italiano, così come il prospetto in inglese, sono disponibili gratuitamente sul nostro sito [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com)

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: [Politica di voto e di impegno](#)

L'OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR 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'OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR o a chiunque altro in merito all'opportunità di investire in titoli in generale o nell'OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR in particolare, né in merito alla capacità del Risk Weighted Enhanced Commodity Ex. Grains Index Total Return USD ("l'Indice") di ottenere performance generali sul mercato delle materie prime. L'unico rapporto di S&P e dei licenziatari terzi con Ossiam 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'OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR né avranno voce sui tempi di emissione o vendita dell'OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR né avranno voce sulla determinazione o sul calcolo dell'equazione con la quale l'OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR viene convertito in liquidità. S&P non avrà alcun obbligo o responsabilità in termini di amministrazione, promozione o negoziazione dell'OSSIAM RISK WEIGHTED ENHANCED COMMODITY EX. GRAINS TR. NÉ S&P, NÉ LE SUE AFFILIATE NÉ TANTOMENO I SUOI LICENZIATARI TERZI GARANTISCONO L'ADEGUATEZZA, L'ACCURATEZZA, LA TEMPISTICA O LA COMPLETEZZA DELL'INDICE NÉ DI QUALSIASI DATO IN ESSO CONTENUTO NÉ DI EVENTUALI COMUNICAZIONI COMPRESSE - IN VIA NON LIMITATIVA - COMUNICAZIONI ORALI O SCRITTE (COMPRESSE LE COMUNICAZIONI IN FORMATO ELETTRONICO) AL RIGUARDO. S&P, LE SUE AFFILIATE E I SUOI LICENZIATARI TERZI NON SARANNO RESPONSABILI PER DANNI NÉ PERSEGUIBILI PER ERRORI, OMISSIONI O RITARDI RISPETTO A QUANTO SOPRA. S&P NON FORMULA ALCUNA GARANZIA ESPRESSA O IMPLICITA E RIFIUTA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA DI COMMERCIALIZZABILITÀ O IDONEITÀ PER UNO SCOPO O USO PARTICOLARE RISPETTO AI PROPRI MARCHI, ALL'INDICE O AI DATI IN ESSO CONTENUTI. SENZA LIMITAZIONE ALCUNA RISPETTO A QUANTO SOPRA, IN NESSUN CASO S&P, LE SUE AFFILIATE O I SUOI LICENZIATARI TERZI SARANNO RESPONSABILI PER DANNI INDIRETTI, SPECIALI, INCIDENTALI, PUNITIVI O CONSEGUENZIALI COMPRESI IN VIA NON LIMITATIVA PERDITA DI PROFITTI, PERDITE COMMERCIALI, PERDITA DI TEMPO O DI CLIENTI, ANCHE QUALORA SIA STATA COMUNICATA LA POSSIBILITÀ DI TALI DANNI IN TERMINI CONTRATTUALI, DI TORTO, RESPONSABILITÀ OGGETTIVA O ALTRO. Standard & Poor's® e S&P® sono marchi registrati di Standard & Poor's Financial Services LLC. "Calculated by S&P Custom Indices" e il relativo marchio stilizzato sono marchi di servizio di Standard & Poor's Financial Services LLC concessi in licenza a Ossiam.

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.

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.