

Al 30.04.2024

## 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.

#### Vantaggi:

- Exposure to the equity risk premium consistent with an ESG approach
- Volatility reduction objective
- Benefit from the low volatility anomaly

### PERFORMANCE (NETTA) DAL LANCIO DEL FONDO



### PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento ann. 3-anni %	Rendimento ann. 5-anni %	Rendimento ann. dal lancio %
Fondo	-1.96	9.11	9.25	6.80	7.41	11.53
Indice	-2.07	9.09	9.44	7.07	7.82	11.90
Universo di Investimento	-3.13	9.50	27.15	11.25	13.71	15.42

Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics.

### PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità ann. %	Alpha Ann. %	Beta	Tracking Error 1-anno %	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	14.64	0.66	0.71	0.15	0.78	-30.43
Indice	14.65	1.02	0.71	---	0.80	-30.34
Universo di Investimento	18.48	---	---	---	0.83	-33.65

Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, 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 indicativi di quelli 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 DI RISCHIO



La Classe di azioni è classificata con un livello di rischio 4 sulla scala di riferimento di rischio, basata su dati storici. A causa dell'esposizione ai mercati azionari, il Fondo può essere soggetto a una notevole volatilità, come indicato dalla classificazione della scala precedente. I risultati passati non sono necessariamente indicativi di quelli futuri. La categoria di rischio indicata non è garantita e può variare nel tempo. Non esiste alcuna garanzia o protezione del capitale sul valore del Fondo. La categoria più bassa non significa "priva di rischio". Potreste perdere tutto o parte del vostro investimento.

### 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 Index
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	Sì
Classificazione SFDR	Article 8
Tipo	ETF passivo
Dividendi	Reinvestiti
AuM totale del fondo	USD 20 863 388
AuM della classe	EUR 7 810 107
Net Asset value	EUR 273.751
Numero di azioni	28 530
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 <sup>1</sup>	15:00 (orario in Irlanda)
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	OSX2 GY
Euronext Paris in EUR	SPMV FP
SIX Swiss Exchange in EUR	SPMV SW
Borsa Italiana in EUR	SPMV IM

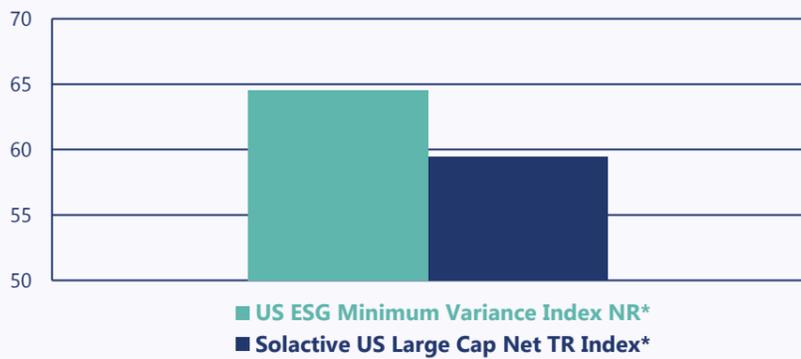
## RIPARTIZIONE SETTORIALE



MT: Materiali • CS: Consumer Staples • CD: Beni voluttuari • FN: Financials • HC: Health Care • ID: Industria • EN: Energia • RE: Immobiliare • CM: Communication Services • IT: Information Technology • UL: Servizi Pubblici

Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics.

## RATING ESG MEDIO



Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics.

## TOP 10 POSIZIONI

	US ESG Minimum Variance Index NR*	Solactive US Large Cap Net TR Index*	ESG Rating
T-MOBILE US INC	4.54%	0.18%	63.25
REPUBLIC SERVICES INC	3.76%	0.09%	66.11
JOHNSON & JOHNSON	3.60%	0.82%	37.63
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	3.15%	0.22%	68.64
CHENIERE ENERGY INC	3.06%	0.09%	69.63
CME GROUP INC	2.91%	0.18%	65.47
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2.56%	0.20%	62.69
WALMART INC	2.55%	0.59%	59.24
PROGRESSIVE CORP/THE	2.50%	0.29%	59.60
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2.48%	0.15%	75.24

Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Standard & Poor's, Solactive AG, Sustainalytics.

## CONTATTI / INFORMAZIONI

www.ossiam.com  
 mail: info@ossiam.com  
 Tel: +33 1 84 79 42 70  
 36 rue Brunel  
 75017 PARIGI - FRANCIA

**Questa è una comunicazione di marketing. Si prega di fare riferimento al prospetto dell'OICVM e al KIID/KID, disponibili gratuitamente su [www.ossiam.com](http://www.ossiam.com), prima di prendere qualsiasi decisione finale di investimento.**

Ossiam IRL ICAV ("ICAV") è un fondo multicomparto costituito come società di investimento di tipo aperto ai sensi della legge irlandese con responsabilità separata tra i comparti e autorizzato dalla Banca Centrale d'Irlanda con il numero C173953. L'ICAV ha nominato Ossiam società di gestione, responsabile della gestione finanziaria dei fondi nonché dell'amministrazione e della distribuzione dell'ICAV. Ossiam, una controllata di Natixis Investment Managers, è approvata dall'Autorità per i mercati finanziari come società di gestione del portafoglio con il numero GP-10000016. L'accuratezza, la completezza o la pertinenza delle informazioni provenienti da fonti esterne non è garantita, anche se sono state compilate da fonti affidabili e rispettabili. Se fornito nel Regno Unito, il presente documento viene distribuito esclusivamente a scopo informativo a clienti professionali o controparti qualificate ai fini del Manuale FCA e non può essere considerato attendibile o utilizzato da nessun altro soggetto.

Per gli investitori in Svizzera: Il rappresentante e l'agente pagatore del fondo in Svizzera è CACEIS Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, filiale di Zurigo, Bleicherweg 7, CH-8027 Zurigo.

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

**Investimenti ESG – Limiti metodologici:** utilizzando i criteri ESG nella politica di investimento, l'obiettivo del fondo interessato sarebbe in particolare quello di gestire meglio il rischio di sostenibilità. I criteri ESG possono essere generati utilizzando i modelli di Ossiam, modelli e dati di terze parti o una combinazione di entrambi. I criteri di valutazione possono evolvere nel tempo o variare a seconda del settore o dell'industria in cui opera l'emittente interessato. L'applicazione dei criteri ESG al processo di investimento può portare Ossiam a investire o escludere titoli per ragioni non finanziarie, indipendentemente dalle opportunità di mercato disponibili. I dati ESG ricevuti da terze parti potrebbero essere di tanto in tanto incompleti, imprecisi o non disponibili. Pertanto, esiste il rischio che Ossiam possa valutare erroneamente un titolo o un emittente, il che comporterebbe l'errata inclusione o esclusione diretta o indiretta di un titolo dal 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](http://www.ossiam.com)

Lo strumento finanziario non è sponsorizzato, promosso, venduto o supportato in qualsiasi altro modo da Solactive AG né Solactive AG offre alcuna garanzia o assicurazione espressa o implicita in merito ai risultati dell'utilizzo dell'Indice e/o del marchio dell'Indice o del Prezzo dell'Indice in qualsiasi momento o sotto qualsiasi altro aspetto. L'indice è calcolato e pubblicato da Solactive AG. Solactive AG si adopera per garantire che l'indice venga calcolato correttamente. Indipendentemente dai suoi obblighi nei confronti dell'Emittente, Solactive AG non ha alcun obbligo di segnalare errori nell'Indice a terzi, inclusi ma non limitati a investitori e/o 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 per scopi di utilizzo in relazione allo strumento finanziario costituiscono una raccomandazione da parte di Solactive AG a investire capitale in detto strumento finanziario né rappresentano in alcun modo un'assicurazione o opinione di Solactive AG in merito a qualsiasi investimento in questo 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.

Per ottenere un riepilogo dei diritti dell'investitore nella lingua ufficiale della propria giurisdizione, consultare la sezione documentazione legale del sito web ([im.natixis.com/intl/intl-fund-documents](http://im.natixis.com/intl/intl-fund-documents))

**In Italia:** Il presente materiale è fornito da Natixis Investment Managers International, società di gestione del risparmio, o dagli uffici della sua succursale Natixis Investment Managers International, Succursale Italiana. Natixis Investment Managers International è una società di gestione di diritto francese autorizzata dall'AMF e registrata al numero GP 90-009 e società anonima registrata al numero 329 450 738. La sede legale di Natixis Investment Managers International è 43 avenue Pierre Mendès France, 75013 Paris. La sede legale di Natixis Investment Managers International, Succursale Italiana è in Via San Clemente 1, 20122 Milan, Italy.

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.

Natixis Investment Managers può decidere di cessare i suoi accordi di commercializzazione per questo fondo in conformità con la legislazione pertinente

**Documento ad uso riservato degli investitori professionali di cui è vietata la diffusione tra il pubblico.**