COMUNICAZIONE DI MARKETING

ESCLUSIVAMENTE PER INVESTITORI PROFESSIONALI O NON PROFESSIONALI CHE INVESTONO NEL FONDO.

OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE® US SECTOR VALUE TR - UCITS ETF 1C (EUR)

Descrizione della strategia

La strategia Shiller Barclays CAPE® US Sector Value è un approccio sistematico di tipo Value che si basa sulle ricerche del Professor Robert Shiller. Tale strategia offre un'esposizione al mercato azionario americano attraverso la rotazione settoriale basata sull'indice Cyclically Adjusted Price-to-Earnings (CAPE®) per selezionare quei settori potenzialmente sottovalutati. Questa strategia è stata creata per offrire un'esposizione al mercato azionario ad alta capitalizzazione con uno stile Value ed è adatta agli investitori buy-and-hold con un orizzonte temporale pluriennale.

Vantaggi:

- Esposizione ai titoli americani attraverso un approccio di selezione di settori industriali basato sull'indicatore CAPE®
- Metrica di valutazione ampiamente utilizzata che si basa sui lavori del Professor Shiller
- Un processo di investimento che intende identificare quei settori potenzialmente sottovalutati nel lungo periodo

Performance (netta) del prodotto dal lancio del fondo



Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

Performance netta (%)

	MTD rendimento	YTD rendimento	Rendimento 1-anno	Rendimento ann. 3-anni	Rendimento ann. 5-anni	Rendimento ann. dal lancio
Fondo	6.94	10.99	12.03	13.33	9.09	12.97
Indice	7.01	11.69	12.85	14.12	9.79	13.62
Universo di investimento	0.85	17.26	15.51	20.71	12.38	13.40

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

Parametri di rischio dal lancio del fondo

	Volatilità ann. %	Alpha ann. %	Beta	Tracking error	Indice di Sharpe	Perdita max. %
Fondo	18.77	0.41	0.94	0.05	0.65	-34.48
Indice	18.78	1.06	0.94	---	0.69	-34.50
Universo di investimento	19.03	---	---	---	0.67	-33.63

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

NOTA BENE: Le performance sono al netto delle commissioni. Il valore dell'investimento e il suo guadagno possono variare cosi 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 é soggetto ai rischi specifici quali i rischi dell'indice, derivati, rischi di controparte 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 di rischio

RISCHIO PIÙ BASSO — RISCHIO PIÙ ELEVATO

1	2	3	**4**	5	6	7

Abbiamo classificato il Fondo nella classe di rischio 4 che è una classe di rischio medio-alta. In altre parole, le perdite potenziali legate ai risultati futuri del prodotto sono a un livello medio-alto e, se la situazione dovesse peggiorare sui mercati, è possibile che la nostra capacità di pagarvi ne risenta. Il rischio di liquidità del mercato potrebbe amplificare la variazione delle performance del prodotto. Oltre ai rischi inclusi nell'indicatore di rischio, altri rischi possono influenzare la performance del Fondo. Si prega di fare riferimento al prospetto informativo del Fondo.

Dati sull'indice

Nome	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index EUR
Universo di investimento	S&P 500 Index NTR EUR
Ticker Bloomberg	BXIICUSE Index
Ticker dell'universo	SPTRNE Index
Classe di attività	Azioni

Dati sul fondo

Depositaria	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam Lux SICAV
UCITS	Sì
Classificazione SFDR	Articolo 6
Dividendi	Reinvestiti
Tipo	ETF passivo
Patrimonio totale del fondo	USD 2,423,671,799
Patrimonio della classe	EUR 568,828,959
Valore patrimoniale netto	EUR 1,538.444
Numero di quote	369,743
Valuta di riferimento del fondo	USD
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU1079841273
Data di lancio	22/06/2015
Metodo di replica	Sintetico
Spese correnti	0.65%

Informazioni

Orario limite sul mercato primario*	16:00 (ora del Lussemburgo)
Investimento minimo sul mercato secondario	1 azione
Borsa Italiana	CAPU IM
Euronext Paris	CAPU FP
SIX Swiss Exchange	CAPU SE
Xetra	USCP GY

**Solo per i Partecipanti Autorizzati e gli investitori ammessi*

COMUNICAZIONE DI MARKETING

ESCLUSIVAMENTE PER INVESTITORI PROFESSIONALI O NON PROFESSIONALI CHE INVESTONO NEL FONDO.

TOP 10

	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index EUR	S&P 500 Index NTR EUR
Meta Platforms Inc	4.79%	2.08%
Alphabet Inc	4.35%	4.54%
NextEra Energy Inc	3.33%	0.27%
Linde PLC	3.33%	0.36%
Walmart Inc	2.97%	0.84%
Costco Wholesale Corp	2.42%	0.69%
Southern Co/The	2.06%	0.17%
Procter & Gamble Co/The	2.02%	0.58%
Coca-Cola Co/The	1.96%	0.56%
Duke Energy Corp	1.89%	0.15%

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

Ripartizione settoriale

	Shiller Barclays CAPE® US Sector Value Net TR Index EUR	S&P 500 Index NTR EUR
Consumer Staples	26.6%	5.0%
Utilities	26.0%	2.1%
Materials	25.8%	1.8%
Communication Services	20.8%	8.3%
Information Technology	0.8%	37.5%
Financials	0.0%	12.2%
Health Care	0.0%	10.3%
Consumer Discretionary	0.0%	9.0%
Industrials	0.0%	8.1%
Energy	0.0%	3.9%
Real Estate	0.0%	1.8%

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, Barclays, S&P.

Avvertenza

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, prima di prendere qualsiasi decisione finale di investimento. Ossiam Lux (la SICAV) è composta da diversi comparti distinti (ciascuno costituente un "Fondo"). La SICAV ha ottenuto il visto della Commissione di Vigilanza del Settore Finanziario del Granducato di Lussemburgo. La SICAV ha nominato Ossiam quale società di gestione responsabile della gestione finanziaria dei fondi, dell'amministrazione e della distribuzione della SICAV. La Società di gestione ha nominato State Street Bank International GmbH, filiale di Lussemburgo, quale Agente amministrativo, Agente per i pagamenti, Agente domiciliatario e Agente societario, nonché Agente per la tenuta del registro e per i trasferimenti della SICAV. Ossiam, una filiale di Natixis Investment Managers, è autorizzata dall'Autorité des Marchés Financiers come società di gestione del portafoglio 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. Quando fornito nel Regno Unito, il presente documento viene distribuito esclusivamente a scopo informativo ai clienti professionali o alle controparti qualificate ai fini del Manuale FCA e non può essere considerato attendibile o utilizzato da nessun altro soggetto.

www.ossiam.com
info@ossiam.com
+33 1 84 79 42 70
36 rue Brunel, 75017 Paris - France

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

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 negati vo significativo, reale o potenziale, sul valore dell'investimento. Per ulteriori informazioni sul dispositivo per l'integrazion e 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.

Il KID/KIID in inglese e il prospetto informativo in inglese sono disponibili gratuitamente sul nostro sito web www.ossiam.com.
Barclays Bank PLC ("BB PLC") e le sue affiliate (collettivamente, "Barclays") non sono né l'emittente né il produttore dell'OSSIAM Shiller Barclays CAPE® US Sector Value TR UCITS ETF, dell'Ossiam Shiller Barclays ETF CAPE® Europe Sector Value TR UCITS, l'Ossiam ESG Low Carbon Shiller Barclays CAPE® US Sector UCITS ETF o l'Ossiam ESG Shiller Barclays CAPE® Europe Sector UCITS ETF (collettivamente, i "Prodotti") e Barclays declina qualsiasi responsabilità nei confronti degli investitori nei Prodotti, a meno che Barclays agisce in qualità di distributore dei Prodotti in base ad un accordo con Ossiam. Il CAPE shiller Barclays® TR Net US Sector Value Index e il shiller Barclays CAPE® TR Net European Sector Value Index (collettivamente, gli "Indici") sono marchi di proprietà o concessi in licenza per l'uso da BB PLC e sono concessi in licenza da Ossiam Lux e/o Ossiam IRL in qualità di "Emittente/i" dei Prodotti. Mentre Ossiam Lux e/o Ossiam IRL, in qualità di Emittenti dei Prodotti, e per proprio conto, eseguono operazioni con Barclays in relazione agli Indici collegati ai Prodotti, gli investitori acquistano i Prodotti da Ossiam Lux e/o da Ossiam IRL, non non ottenere alcun interesse negli Indici e non mantenere alcun rapporto di alcun tipo con Barclays nel contesto di un investimento nei Prodotti. I Prodotti non sono né sponsorizzati né approvati da Barclays, e Barclays non rilascia alcuna dichiarazione in merito a (i) l'idoneità o l'appropriatezza dei Prodotti o (ii) l'uso o il riferimento agli Indici (inclusi ma non limitati a limitazioni, qualsiasi selezione o filtro processo applicato da Ossiam in relazione agli Indici (o qualsiasi componente o elemento costitutivo ad essi correlato) in relazione ai Prodotti ESG gestiti attivamente da Ossiam) o (iii) all'utilizzo di qualsiasi dato ivi incluso, a meno che Barclays non agisca in qualità di distributore dei Prodotti e rende dichiarazioni esplicite in merito alla distribuzione dei Prodotti. Barclays declina ogni responsabilità nei confronti dell'Emittente, degli investitori o di qualsiasi altra terza parte in relazione all'uso o all'accuratezza degli Indici o dei dati in essi contenuti. Per quanto riguarda i prodotti correlati ai fattori ESG, né Barclays né RSBB-I LLC hanno fornito alcun contributo alle metodologie o rating ESG o a basse emissioni di carbonio applicati da Ossiam in relazione a tali prodotti, e né Barclays né RSBB-I LLC pertanto non rilasciano alcuna dichiarazione. per quanto riguarda l'accuratezza, la validità o l'adeguatezza di tali metodologie o rating ESG e a basse emissioni di carbonio. Il Prodotto non costituisce un investimento che finanzia un progetto ESG, ma fornisce solo esposizione a determinati componenti dell'indice sottostante sulla base della metodologia di screening ESG e dei rating applicati da Ossiam. La composizione delle attività sottostanti a cui fa riferimento il Prodotto (compresi i componenti dell'Indice) può variare nel tempo. È importante notare che il rating ESG complessivo è influenzato da una serie di fattori e pertanto, ad esempio, un rating più alto per i fattori ambientali può compensare un rating più basso per i fattori sociali, o viceversa. Barclays sottolinea che attualmente non esiste un quadro o una definizione accettata a livello globale (legale, normativa o di altro tipo), né un consenso di mercato su cosa costituisca un prodotto "ESG", "verde", "sostenibile", "rispettoso del clima" o un prodotto etichettato in modo equivalente, o sugli attributi precisi richiesti affinché un particolare investimento, prodotto o asset possa essere definito "ESG", "verde", "sostenibile", "rispettoso del clima" o qualcos'altro. altra etichetta equivalente e non può essere data alcuna garanzia che una definizione così chiara o un consenso così chiaro si svilupperanno nel tempo. Barclays non rilascia dichiarazioni o assicurazioni in merito alla performance ESG dell'investimento, del prodotto, dell'indice o dell'asset, al suo allineamento o conformità con qualsiasi regime normativo o a qualsiasi valutazione della sua controllata o di terze parti, o qualsiasi futura performance ESG, allineamento o conformità con qualsiasi regime normativo o con qualsiasi valutazione di società affiliate o di terzi. Barclays non rilascia alcuna dichiarazione o garanzia che l'investimento, il prodotto o l'asset soddisferà tutti o parte degli obiettivi o aspettative degli investitori o degli utenti in merito a eventuali obiettivi rilevanti "ESG", "verdi", "sostenibili". » o altri obiettivi etichettati in modo equivalente, o che non si verificheranno impatti ambientali, sociali e/o di altro tipo, pertanto non può esserci alcuna garanzia circa la fattibilità dell'investimento, dell'indice, del prodotto o dell'asset ai fini ESG.
Eventuali dubbi sulla fattibilità dell'investimento, del prodotto, dell'indice o dell'asset ai fini ESG possono limitare la liquidità e influenzare negativamente il valore di mercato dell'investimento, del prodotto o dell'asset o, nel caso degli indici, di qualsiasi investimento, prodotto o asset che utilizza tali indici. Eventuali caratteristiche di sostenibilità, criteri di investimento a impatto o altre caratteristiche ESG possono di per sé limitare la liquidità o influenzare negativamente il valore di mercato dell'investimento, prodotto o attività o, nel caso degli indici, qualsiasi investimento, prodotto o attività che utilizza tali indici. Barclays non ha effettuato alcuna valutazione dell'investimento, del prodotto, dell'indice o dell'asset per verificarne la conformità ai fini della classificazione del Regolamento UE sull'informativa sulla finanza sostenibile, ai fini del Regolamento UE sulla tassonomia o di schemi di classificazione equivalenti ("Schemi di classificazione ") o comunque li hanno presi in considerazione per tali scopi. Si ricorda agli investitori, agli utenti e agli altri soggetti rilevanti che dovranno effettuare le proprie valutazioni a tali fini e che Barclays non si assume alcuna responsabilità al riguardo. Le informazioni e i dati contenuti o a cui si fa riferimento nel presente documento sono stati forniti da terzi. Barclays non garantisce che le informazioni o i dati ESG di terze parti siano accurati o completi, o che Barclays abbia (direttamente o tramite terzi) adottato misure per verificare in modo indipendente o altrimenti verificare tali informazioni e dati. Di conseguenza, Barclays non si assume alcuna responsabilità per eventuali perdite dirette, indirette o consequenziali derivanti da qualsiasi azione o inazione intrapresa facendo affidamento sulle informazioni o altro contenuto qui contenuto o in connessione con le decisioni prese nell'ambito della classificazione degli schemi da parte di investitori, utenti e altri soggetti interessati. . Si ricorda agli investitori, agli utenti e alle altre parti interessate che sono possibili divergenze di opinione. Soggetti diversi (compresi fornitori di dati terzi, investitori e altri istituti finanziari) possono interpretare e applicare criteri diversi, anche utilizzando metodologie interne, e giungere a conclusioni diverse riguardo all'investimento, all'indice, al prodotto o all'asset. Si consiglia agli investitori, agli utenti e alle altre persone rilevanti di ottenere la propria consulenza finanziaria, legale, normativa, fiscale o di altro tipo, se necessario, al fine di prendere la propria decisione di investimento in merito al fatto che l'indice, l'investimento, il prodotto o l'attivo soddisfi le loro esigenze e di fare la propria determinazione in merito all'indice, all'investimento, al prodotto o all'attività e al futuro dell'indice, dell'investimento, del prodotto o dell'attività, inclusa la performance ESG, l'allineamento ESG e l'allineamento o la conformità a qualsiasi regime normativo (inclusi, a titolo esemplificativo, i regimi di classificazione).
Bloomberg Index Services Limited è l'agente ufficiale per il calcolo e la manutenzione dell'indice, che è di proprietà e amministrato da Barclays. Bloomberg Index Services Limited non garantisce la tempestività, l'accuratezza o la completezza dei calcoli dell'indice o di qualsiasi dato o informazione ad esso relativa. Bloomberg Index Services Limited non fornisce alcuna garanzia, esplicita o implicita, in merito all'Indice o a qualsiasi dato o valore ad esso correlato o ai risultati che ne derivano, e declina espressamente ogni garanzia di commerciabilità e idoneità allo scopo, in particolare a questo riguardo. Nella misura massima consentita dalla legge, Bloomberg Index Services Limited, le sue affiliate e tutti i rispettivi partner, dipendenti, appaltatori, agenti, fornitori e venditori (collettivamente, le "Parti protette") declinano qualsiasi responsabilità, condizionale o meno, per qualsiasi lesioni o danni, causati dalla negligenza di una parte protetta o altrimenti, derivanti dal calcolo dell'Indice o da qualsiasi dato o valore ad esso correlato e non sono responsabili per perdite di profitti, perdite, danni punitivi, incidentali o consequenziali. 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 dei dati o della metodologia in essi inclusi o su cui si basano. Né RSBB-I, LLC né Robert J. Shiller e il suo consulente, IndexVestLAB, LLC e i suoi consulenti, si assumono alcuna responsabilità per errori, omissioni o interruzioni ad essi relativi e non forniscono alcuna garanzia, esplicita o implicita, in merito alle prestazioni o ai risultati ottenuti da chiunque dall'uso delle informazioni in esso contenute o su cui si basa, declina espressamente qualsiasi garanzia di commerciabilità o idoneità per uno scopo particolare in relazione ad esso, e non sarà responsabile per eventuali reclami o perdite di qualsiasi natura relativi al utilizzo di queste informazioni, inclusi, ma non limitati a, perdita di profitti o danni punitivi o consequenziali, anche se RSBB-I, LLC o una qualsiasi altra parte è informata di questa probabilità. Né RSBB-I, LLC né Robert J. Shiller e il suo consulente, IndexVestLAB, LLC e i suoi consulenti hanno fornito informazioni sulle metodologie o rating ESG o a basse emissioni di carbonio applicati da Ossiam in relazione a qualsiasi Prodotto correlato a ESG e pertanto non rilasciano alcuna garanzia in merito all'accuratezza, validità o idoneità di tali ESG e metodologie o valutazioni a basse emissioni di carbonio. L'indice Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR è calcolato da Barclays Bank plc utilizzando i valori dell'indice di fine giornata concessi in licenza da MSCI ("Dati MSCI"). I dati MSCI vengono forniti "COSÌ COME SONO" senza garanzia o responsabilità e non è consentita la copia o la distribuzione. MSCI non rilascia alcuna dichiarazione in merito all'opportunità di qualsiasi investimento o strategia e non sponsorizza, promuove, emette, vende, raccomanda o approva alcun investimento o strategia, incluso qualsiasi prodotto o strategia finanziaria basata su, seguendo o altrimenti utilizzando i dati MSCI. , modelli, analisi o altri documenti o informazioni.
L'accesso ai prodotti e ai servizi descritti nel presente documento può essere soggetto a restrizioni per alcune persone o in alcuni paesi. Nessuno dei prodotti o servizi qui presentati sarà fornito da Ossiam a persone non legalmente autorizzate. Lo stesso vale per i paesi per i quali Ossiam non ha presentato domanda di autorizzazione all'immissione in commercio.

Avvertenze

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 esse 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.

Prima di investire si prega di leggere attentamente il prospetto e il documento contenente le informazioni chiave per gli investitori (KID). Se il fondo è registrato nella vostra giurisdizione, questi documenti sono disponibili gratuitamente e nella lingua ufficiale del paese di registrazione nel sito di Natixis Investment Managers (im.natixis.com/Intl/Intl-fund-documents).

Per ottenere un riepilogo dei diritti dell'investitore nella lingua ufficiale della vostra giurisdizione, consultare la sezione documentazione legale del sito web (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 società Iscritta nell'elenco allegato all'Albo delle SGR tenuto dalla Banca d'Italia al n. MI - 2637562. 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 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 a livello 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. Gli investitori devono considerare attentamente gli obiettivi di investimento, i rischi e le spese di qualsiasi investimento prima di investire. 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 variazioni e non possono essere considerati come aventi valore contrattuale. Non vi è alcuna garanzia che le evoluzioni future corrispondano alle previsioni contenute nel presente materiale. Le analisi e le opinioni espresse da terze parti sono indipendenti e non riflettono necessariamente quelle di Natixis Investment Managers. Le informazioni presentate sulla performance passata non sono indicative della performance futura.

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.