COMUNICAZIONE A CARATTERE PUBBLICITARIO

Al 30.04.2024

OSSIAM SHILLER BARCLAYS CAPE EUROPE SECTOR VALUE TR UCITS ETF 1C (EUR)

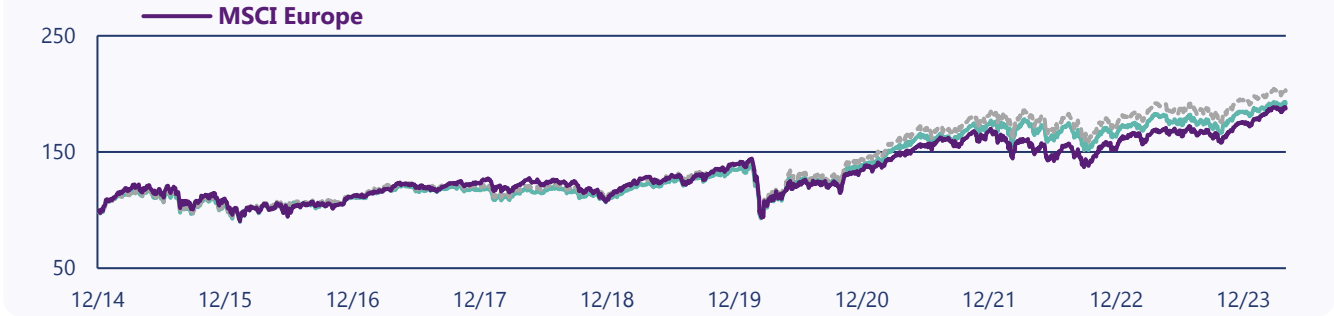
DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

La strategia Shiller Barclays CAPE® Europe 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 europeo 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 europei 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) DAL LANCIO DEL FONDO



Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Barclays, MSCI.

PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento ann. 3-anni %	Rendimento ann. 5-anni %	Rendimento ann. dal lancio %
Fondo	-0,92	3,59	4,92	7,31	9,17	7,20
Shiller Europe	-0,86	3,81	5,58	7,94	9,78	7,85
MSCI Europe	-0,71	6,65	10,98	8,03	7,79	6,96

Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Barclays, MSCI.

PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità ann. %	Alpha Ann. %	Beta	Tracking Error 1-anno %	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	17,06	0,63	0,94	0,07	0,41	-33,03
Shiller Europe	17,08	1,27	0,95	---	0,45	-33,05
MSCI Europe	17,32	---	---	---	0,39	-35,25

Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Barclays, MSCI.

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 y rischio 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.
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**

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.

BENCHMARKS

Nome: Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index ("Shiller Europe")
Ticker: BXIICESE Index

Nome: MSCI Europe Net Return Index ("MSCI Europe")
Ticker: MSDEE15N Index

DATI SUL FONDO

Depositaria	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam Lux SICAV
UCITS	Si
Classificazione SFDR	Article 6
Tipo	ETF passivo
Dividendi	Non
AuM totale del fondo	EUR 165 133 158
AuM della classe	EUR 165 133 158
Net Asset value	EUR 508.559
Numero di azioni	324 708
Valuta del fondo	EUR
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU1079842321
Data di lancio	30.12.2014
Metodo di replica	Sintetico
TER	0.65%

INFORMAZIONI

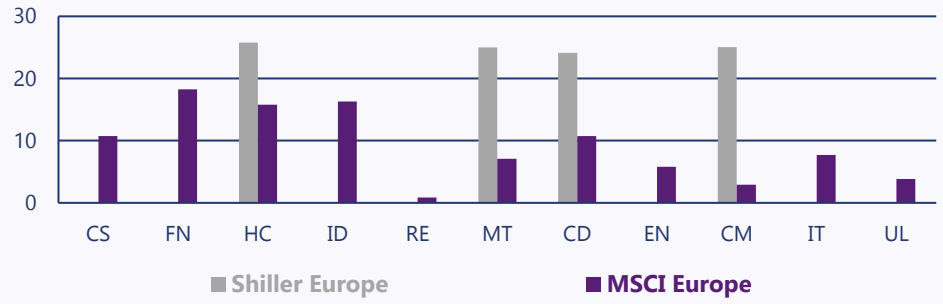
Cut-off[1]	14:45 (ora del Lussemburgo)
Investimento minimo sul mercato secondario	1 Azione

[1]Sottoscrizioni sul mercato primario disponibili solo per Partecipanti Autorizzati e investitori approvati.

London Exchange in EUR	CAPE LN
London Exchange in GBP	LCPE LN
XETRA in EUR	EUPE GY
Euronext Paris in EUR	CAPE FP
SIX Swiss Exchange in EUR	CAPE SW
Borsa Italiana in EUR	CAPE IM

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

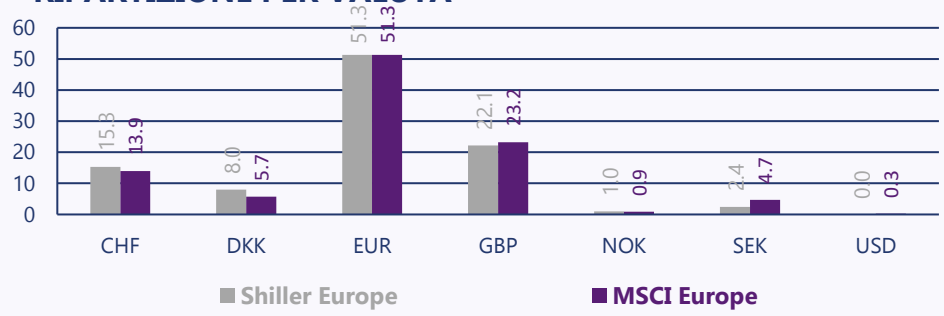
RIPARTIZIONE SETTORIALE



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, Barclays, MSCI.

RIPARTIZIONE PER VALUTA



CHF: Franco Svizzero • DKK: Corona danese • EUR: Euro • GBP: Sterlina Britannica • NOK: Krona Norwegia • SEK: Corona Svedese • USD: Dollaro USA

Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Barclays, MSCI.

TOP 10 POSIZIONI

	Shiller Barclays CAPE® Europe Sector Value Net TR Index	MSCI Europe Net Return Index (EUR)
NOVO NORDISK A/S	6.42%	3.93%
DEUTSCHE TELEKOM AG	5.91%	0.69%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITT	4.79%	2.13%
ASTRAZENECA PLC	3.56%	2.18%
AIR LIQUIDE SA	3.39%	0.96%
NOVARTIS AG	3.03%	1.85%
ROCHE HOLDING AG	2.70%	1.57%
RIO TINTO PLC	2.53%	0.72%
PUBLICIS GROUPE SA	2.02%	0.24%
GLENCORE PLC	2.00%	0.56%

Dati calcolati da Ossiam al 30.04.2024. Fonte: Ossiam, Refinitiv, Barclays, MSCI.

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 sul sito www.ossiam.com, prima di prendere qualsiasi decisione definitiva di investimento.
Ossiam Lux (la SICAV) composta da diversi comparti separati (ciascuno dei quali costituisce un "Comparto"). La SICAV ha ricevuto il visto della Commissione di vigilanza del settore finanziario del Granducato di Lussemburgo. La SICAV ha nominato Ossiam come 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 Conservatore del Registro e Agente per i Trasferimenti della SICAV. Ossiam, una controllata 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 sono garantite, sebbene siano state raccolte da fonti affidabili e rispettabili. Quando viene fornito nel Regno Unito, il presente documento è distribuito a scopo informativo solo ai Clienti Professionali o alle Controparti Idonee ai fini del Manuale FCA e non può essere fatto valere o utilizzato da nessun altro soggetto.
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.
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.

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.
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)
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.