

Al 28.02.2025

## Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y Carbon Reduction UCITS ETF 1C (EUR)

### DESCRIZIONE DELLA STRATEGIA

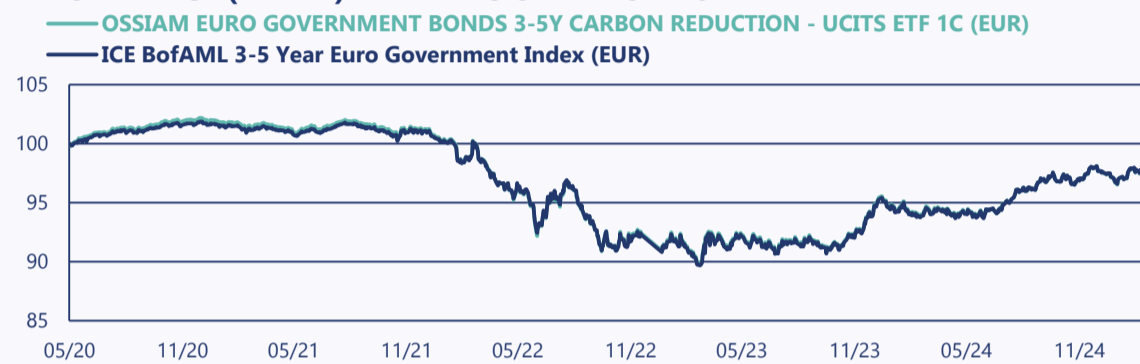
L'obiettivo dell'ETF Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y Carbon Reduction è replicare la performance dell'indice ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index (Bloomberg E2CR Index) al lordo di commissioni e spese. L'indice è composto da una selezione di titoli di Stato emessi da Paesi dell'Eurozona e denominati in Euro, con scadenza compresa tra 3 e 5 anni.

La strategia ha come obiettivo la riduzione l'intensità carbone rispetto all'indice benchmark ICE BofAML 3-5 Year Euro Government, che ne costituisce l'universo d'investimento, attraverso una procedura di ottimizzazione. Il processo d'investimento pone dei limiti alle deviazioni in termini di esposizione per Paese rispetto al benchmark. Le misurazioni di intensità carbone (e quindi di efficienza energetica) sono calcolate utilizzando le emissioni pro-capite di origine fossile per ciascun Paese nel portafoglio (emissioni CO2 rispetto alla popolazione). La metodologia dell'indice è disponibile qui: [indices.theice.com](https://indices.theice.com).

Principali vantaggi della strategia:

- offre un'esposizione ai titoli di Stato con scadenza compresa tra i 3 e 5 anni dei Paesi dell'Eurozona;
- riduce l'impronta di CO2 del portafoglio complessivo nel lungo periodo;
- prevede esposizioni per Paese le cui deviazioni rispetto al benchmark sono limitate

### PERFORMANCE (NETTA) DAL LANCIO DEL FONDO



Dati calcolati da Ossiam al 28.02.2025. Fonte: Ossiam, ICE Data Indices LLC.

### PERFORMANCE NETTE

	MTD rendimento %	YTD rendimento %	Rendimento 1-anno %	Rendimento ann. 3-anni %	Rendimento ann. 5-anni %	Rendimento ann. dal lancio %
Fondo	0,60	0,73	4,42	-0,33	---	-0,39
Indice	0,59	0,67	4,51	-0,35	-0,58	-0,37
Universo di investimento	0,62	0,73	4,59	-0,31	---	-0,38

Dati calcolati da Ossiam al 28.02.2025. Fonte: Ossiam, ICE Data Indices LLC.

### PARAMETRI DI RISCHIO DAL LANCIO DEL FONDO

	Volatilità ann. %	Alpha Ann. %	Beta	Tracking Error %	Sharpe Ratio	Max Drawdown %
Fondo	3,39	0,00	1,01	0,29	-0,52	-12,07
Indice	3,05	-0,03	0,91	---	-0,57	-12,13
Universo di investimento	3,35	---	---	---	-0,52	-11,96

Dati calcolati da Ossiam al 28.02.2025. Fonte: Ossiam, ICE Data Indices LLC.

**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:** L'indice di riferimento non è destinato ad essere allineato alle ambizioni ambientali o sociali quali promosse dal Fondo. 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. 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.

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



Abbiamo classificato il Fondo nella classe di rischio 2, che è una classe di rischio bassa. In altre parole, le perdite potenziali legate ai risultati futuri del prodotto sono a un livello basso e, se la situazione dovesse peggiorare sui mercati, è molto improbabile 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	ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index (EUR)
Universo di investimento	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index (EUR)
Ticker Bloomberg	E2CR Index
Inception Date	31.12.2000
Data di lancio	Fixed Income
Frequenza dei ribilanciamenti	Mensile

### DATI SUL FONDO

Depositaria	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
Forma giuridica	Compartimento della Ossiam Lux SICAV
UCITS	Si
Classificazione SFDR	Article 8
Tipo	ETF passivo
AuM totale del fondo	EUR 519 254 003
AuM della classe	EUR 519 254 003
Net Asset value	EUR 199.720
Numero di azioni	2 599 908
Valuta del fondo	EUR
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU2069380306
Data di lancio	13.05.2020
Metodo di replica	Fisico
TER	0.17%

### INFORMAZIONI

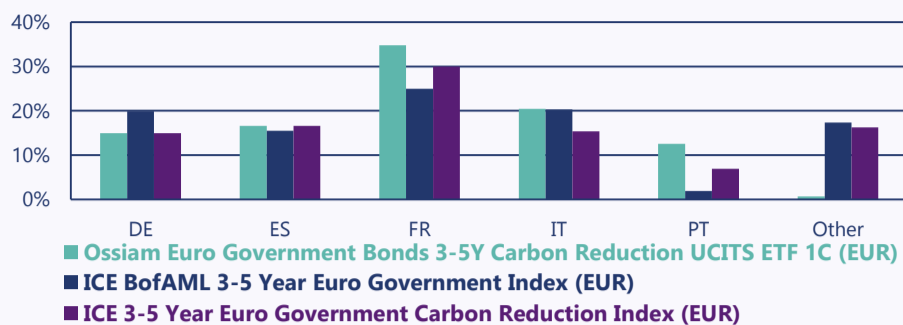
Cut-off<sup>1</sup> 15:00 (ora del Lussemburgo)

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	OG35 GY
SIX Swiss Exchange in EUR	OG35 SW
Borsa Italiana in EUR	OG35 IM

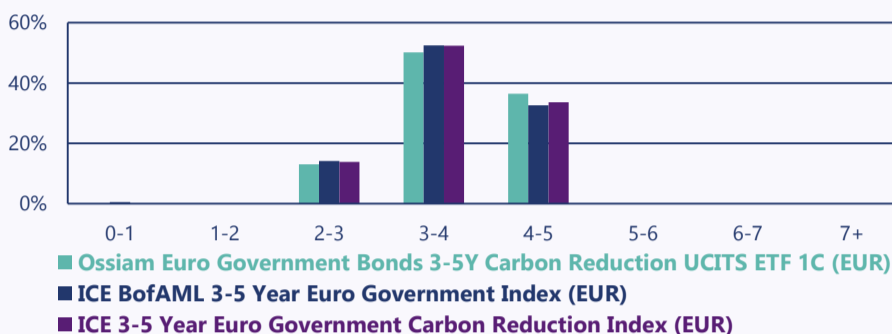
## RIPARTIZIONE GEOGRAFICA



DE: Germania • ES: Spagna • FR: Francia • IT: Italia • PT: Portogallo

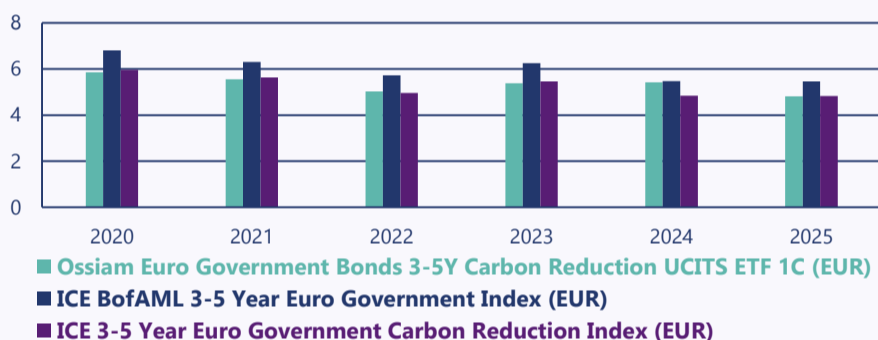
Dati calcolati da OssiAm al 28.02.2025. Fonte: OssiAm, ICE Data Indices LLC.

## RIPARTIZIONE DELLA DURATION



Dati calcolati da OssiAm al 28.02.2025. Fonte: OssiAm, ICE Data Indices LLC.

## Emissioni di CO2 fossili pro capite ( tCO2/capite/anno) \*



Dati calcolati da OssiAm al 28.02.2025. Fonte: OssiAm, ICE Data Indices LLC.

\*Emissioni medie di CO2 originate dal consumo di energie fossili.

## TOP 10 POSIZIONI

	OssiAm Euro Government Bonds 3-5Y Carbon Reduction	ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index
France (Republic Of)	6.77%	4.17%	3.93%
France (Republic Of)	6.51%	3.89%	3.65%
Portugal (Republic Of)	4.84%	2.32%	0.88%
Portugal (Republic Of)	4.70%	2.31%	1.09%
France (Republic Of)	4.39%	4.41%	4.19%
France (Republic Of)	4.20%	4.19%	3.95%
France (Republic Of)	3.61%	3.75%	3.48%
France (Republic Of)	3.54%	3.36%	3.08%
France (Republic Of)	3.34%	3.52%	0.28%
France (Republic Of)	3.29%	3.23%	2.94%

Dati calcolati da OssiAm al 28.02.2025. Fonte: OssiAm, ICE Data Indices LLC.

## CARATTERISTICHE DEL PORTAFOGLIO

	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index	ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index
DURATION (in years)	3.75	3.76
ADJUSTED DURATION (in years)	2.37	2.45
YIELD TO MATURITY %	2.36	2.44

Dati calcolati da OssiAm al 28.02.2025. Fonte: OssiAm, ICE Data Indices LLC.

## 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 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.

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 KID/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)

La fonte ICE Data Indices, LLC ("Dati ICE") viene utilizzata con autorizzazione. "ICE" è un servizio/marchio commerciale di ICE Data Indices, LLC o delle sue affiliate ed è stato concesso in licenza, insieme all'ICE 3-5 Year Euro Government Carbon Reduction Index ("Indice") per l'utilizzo da parte di OssiAm in relazione all'OssiAm Titoli di Stato in Euro a 3-5 anni Carbon Reduction (il "Prodotto"). Né OssiAm, OssiAm Lux (la "SICAV") né il Prodotto, a seconda dei casi, sono sponsorizzati, approvati, venduti o promossi da ICE Data Indices, LLC, dalle sue affiliate o dai suoi fornitori terzi ("ICE Data e i suoi fornitori"). ICE Data e i suoi Fornitori non rilasciano dichiarazioni o garanzie in merito all'opportunità di investire in titoli in generale, nel Prodotto in particolare, nella SICAV o nella capacità dell'Indice di replicare la performance generale del mercato azionario. L'unico rapporto di ICE Data con OssiAm è la concessione di licenza di determinati marchi e nomi commerciali e dell'Indice o dei suoi componenti. L'Indice è determinato, composto e calcolato da ICE Data indipendentemente dal LICENZIATARIO o dal Prodotto o dai suoi detentori. ICE Data non ha alcun obbligo di prendere in considerazione le esigenze del Licenziatario o dei detentori del Prodotto nella determinazione, composizione o calcolo dell'Indice. ICE Data non è responsabile e non ha partecipato alla determinazione dei tempi, dei prezzi o delle quantità del Prodotto da emettere o alla determinazione o al calcolo dell'equazione in base alla quale il Prodotto deve essere prezzato, venduto, acquistato o redento. Ad eccezione di alcuni servizi di calcolo dell'indice personalizzato, tutte le informazioni fornite da ICE Data sono di natura generale e non adattate alle esigenze del LICENZIATARIO o di qualsiasi altra persona, entità o gruppo di persone. ICE Data non ha alcun obbligo o responsabilità in relazione all'amministrazione, alla commercializzazione o al commercio del Prodotto. ICE Data non è un consulente per gli investimenti. L'inclusione di un titolo all'interno di un indice non costituisce una raccomandazione da parte di ICE Data ad acquistare, vendere o detenere tale titolo, né è considerata un consiglio di investimento. ICE DATA E I SUOI FORNITORI DECLINANO OGNI GARANZIA E DICHIARAZIONE, ESPLICITA E/O IMPLICITA, COMPRESI QUALSIASI GARANZIA DI COMMERCIALIZZABILITÀ O IDONEITÀ PER UNO SCOPO O UTILIZZO PARTICOLARE, COMPRESI GLI INDICI, I DATI DELL'INDICE E QUALSIASI INFORMAZIONE INCLUSA, CORRELATA O DERIVATA DA QUESTO ("DATI INDICE"). ICE DATA E I SUOI FORNITORI NON SARANNO SOGGETTI AD ALCUN DANNO O RESPONSABILITÀ RISPETTO ALL'ADEGUATEZZA, ACCURATEZZA, TEMPESTIVITÀ O COMPLETEZZA DEGLI INDICI E DEI DATI DELL'INDICE, CHE SONO FORNITI "COSÌ COME SONO" E IL TUO UTILIZZO È A TUA PROPRIETÀ RISCHIO.

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.

ossiam

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

**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 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.

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](http://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](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 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.