COMUNICAZIONE DI MARKETING

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

OSSIAM EURO GOVERNMENT BONDS 3-5Y - UCITS ETF 1C (EUR)

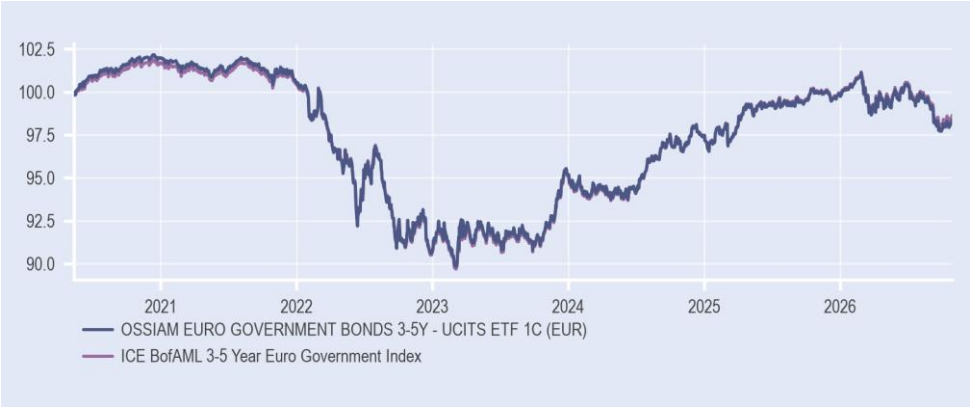
Descrizione della strategia

L'obiettivo del Fondo è conseguire un apprezzamento del capitale nel lungo termine attraverso la performance di un sottoinsieme selezionato di obbligazioni emesse pubblicamente dai Paesi membri dell'Eurozona. Il Fondo è un ETF UCITS a gestione attiva. Il Fondo è composto da una selezione di obbligazioni sovrane denominate in EUR con una durata residua superiore a 3 anni e inferiore a 5 anni, emesse pubblicamente dai Paesi membri dell'Eurozona.
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'investiment 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 originie fossile per ciascun Paese nel portafoglio (emissioni CO2 rispetto alla popolazione). La metodologia dell'indice è disponibile qui: 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) del prodotto dal lancio del fondo



Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, ICE Data Indices LLC.

Performance netta (%)

	MTD rendimento	YTD rendimento	Rendimento 1-anno	Rendimento ann. 3-anni	Rendimento ann. 5-anni	Rendimento ann. dal lancio
Fondo	0.54	-1.46	-1.64	2.27	-0.41	-0.25
Universo di investimento	0.55	-1.26	-1.43	2.39	-0.31	-0.21

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, ICE Data Indices LLC.

Parametri di rischio dal lancio del fondo

	Volatilità ann. %	Alpha ann. %	Beta	Indice di Sharpe	Perdita max. %
Fondo	3.22	-0.04	1.01	-0.56	-12.07
Universo di investimento	3.17	---	---	-0.56	-11.96

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, ICE Data Indices LLC.

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: L'indice di riferimento non è destinato ad essere allineato alle ambizioni ambientali o sociali quali promosse dal Fondo. Si noti che il fondo é 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.

Questo fondo promuove criteri ambientali, sociali e di governance (ESG), ma non ha come obiettivo un investimento sostenibile.

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 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. Itre 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 BofAML 3-5 Year Euro Government Index (EUR)
Ticker Bloomberg	E2CR Index
Classe di attività	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	Articolo 8
Dividendi	Reinvestiti
Tipo	ETF gestito attivamente
Patrimonio totale del fondo	EUR 574,549,900
Patrimonio della classe	EUR 574,549,900
Valore patrimoniale netto	EUR 200.177
Numero di quote	2,870,208
Valuta di riferimento del fondo	EUR
Valuta della classe	EUR
ISIN	LU2069380306
Data di lancio	13/05/2020
Metodo di replica	Fisica
Spese correnti	0.17%

Informazioni

Orario limite sul mercato primario*	15:00 (ora del Lussemburgo)
Investimento minimo sul mercato secondario	1 azione
Borsa Italiana	OG35 IM
SIX Swiss Exchange	OG35 SW
Xetra	OG35 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

	Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index
France 2.5 % 25/05/2030	5.17%	4.49%
France 1.5 % 25/05/2031	4.82%	4.06%
France 2.7 % 25/02/2031	4.58%	3.97%
France 2.75 % 25/02/2030	4.52%	3.79%
France 0 % 25/11/2030	4.15%	3.18%
France 0 % 25/11/2029	3.92%	2.82%
Portugal 3.875 % 15/02/2030	3.26%	0.56%
Portugal 0.475 % 18/10/2030	2.94%	0.69%
Greece 1.5 % 18/06/2030	2.85%	0.33%
Greece 0.75 % 18/06/2031	2.81%	0.34%

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, ICE Data Indices LLC.

Ripartizione geografica

	Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index
France	27.3%	22.3%
Italy	25.9%	23.9%
Spain	17.5%	12.5%
Germany	16.7%	21.7%
Portugal	6.8%	1.8%
Greece	5.7%	0.7%

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, ICE Data Indices LLC.

Ripartizione per duration

	Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index
0-3	7.4%	7.5%
3-4	63.0%	62.0%
4+	24.5%	25.7%

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, ICE Data Indices LLC.

Caratteristiche del portafoglio

	Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index
Duration (in years)	3.68	3.70
Adjusted duration (in years)	3.61	3.64
Yield to maturity %	3.63	3.56

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, ICE Data Indices LLC.

CO2 fossile pro capite

	Ossiam Euro Government Bonds 3-5Y	ICE BofAML 3-5 Year Euro Government Index
2020	5.85	6.42
2021	5.55	5.56
2022	5.02	6.06
2023	5.38	6.25
2024	5.42	5.47
2025	4.79	5.38
2026	4.87	5.48

Dati calcolati da Ossiam al 30.10.2026. Fonte: Ossiam, Bloomberg, ICE Data Indices LLC.

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 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.

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.

Il KID/KIID in inglese, così come il prospetto in inglese, sono disponibili gratuitamente sul nostro sito web www.ossiam.com.
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.
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, COMPRESE QUALSIASI GARANZIA DI COMMERCIABILITÀ 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.

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.