

Investment Solutions by Epsilon - Multiasset Absolute

3 anni - 07-2016 R1



Dati al 30.06.2022

Categoria Assogestioni Flessibili
Inizio operatività 05 luglio 2016
Patrimonio netto 22 mil. euro
Valore quota 92,49 euro
Morningstar Rating™ Senza Rating
ISIN LU1388496512

Nome del gestore Maria Bruna Riccardi
Loredana Greco

Benchmark

In relazione allo stile gestionale del Comparto, non è possibile individuare un benchmark idoneo a rappresentare gli obiettivi di investimento ed il profilo di rischio.

Profilo di rischio/rendimento del comparto

RISCHIO PIU' BASSO RISCHIO PIU' ELEVATO

←----->

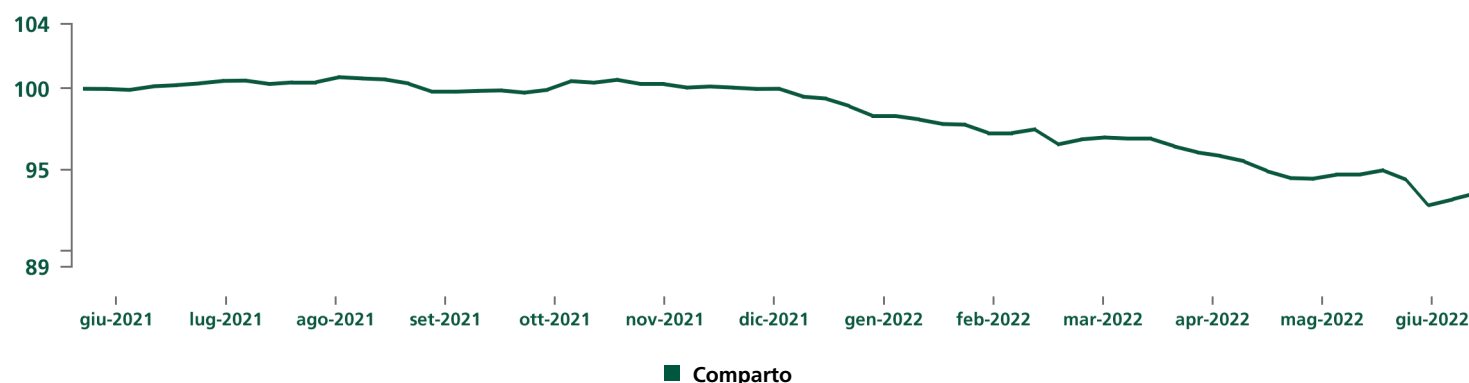
Rendimento potenzialmente più basso

Rendimento potenzialmente più elevato

1 2 3 4 5 6 7

I dati storici utilizzati per calcolare l'indicatore sintetico potrebbero non costituire un'indicazione affidabile circa il futuro profilo di rischio del Comparto. La categoria di rischio/rendimento indicata potrebbe non rimanere invariata, e quindi la classificazione del Comparto potrebbe cambiare nel tempo. Si veda il KIID e il Prospetto per l'elenco completo dei rischi di questo Comparto.

Andamento del valore della quota del comparto



| Rendimenti | 1 mese | 3 mesi | Da inizio anno | 1 anno | 3 anni |
|------------|--------|--------|----------------|--------|--------|
| Comparto | -1,2% | -3,5% | -6,4% | -6,4% | -4,9% |

Commento del gestore

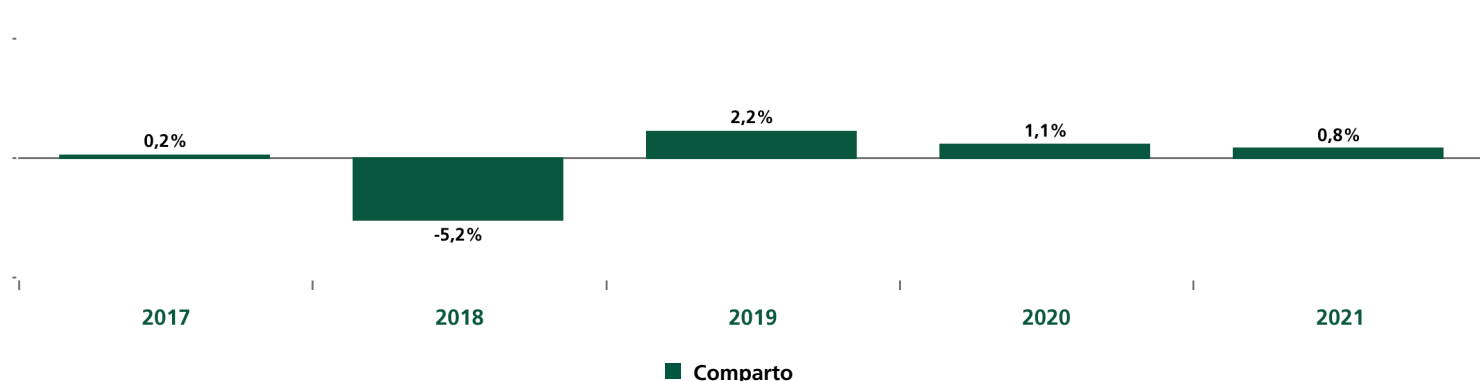
La strategia di gestione di Investment Solutions by Epsilon - Multiasset Absolute 3 anni ricerca un rendimento positivo investendo con un approccio diversificato e flessibile su obbligazioni, azioni e materie prime (per un massimo del 10% del patrimonio netto), implementando strategie tendenzialmente poco correlate rispetto alle asset class tradizionali, con una forte attenzione al controllo del rischio.

Il Comparto combina una gamma di strategie aventi come obiettivo il rendimento assoluto indipendentemente dall'andamento dei mercati.

In particolare, il Gestore implementa strategie quantitative e discrezionali, il cui peso sarà determinato dalle view della Società, dalle condizioni del mercato, dalle attese di rischio/rendimento delle singole strategie e dalle correlazioni con le altre strategie.

Il Gestore utilizza inoltre tecniche di mitigazione del rischio, in particolare un indicatore che ha l'obiettivo di individuare periodi di maggior concentrazione del rischio e di conseguenza da indicazioni al Gestore su come modulare il peso delle strategie e se necessario implementa operazioni a copertura.

Rendimento annuo del comparto



Investment Solutions by Epsilon - Multiasset Absolute

3 anni - 07-2016 R1



Dati al 30.06.2022

| Rendimento del comparto al 30.06.2022 | Comparto |
|---|----------|
| Rendimento ultimi 12 mesi | -6,4% |
| Rendimento medio annuo composto ultimi 3 anni | -1,6% |
| Rendimento medio annuo composto ultimi 5 anni | -1,4% |

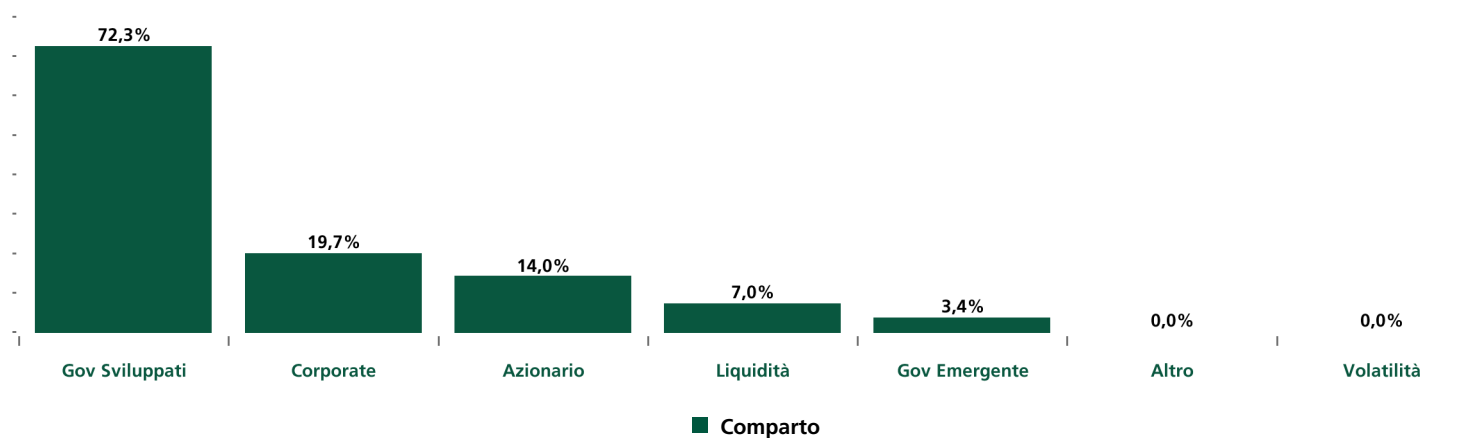
Dati aggiornati all'ultimo trimestre solare concluso

Principali strumenti finanziari in portafoglio

| Codice Isin | Titolo | Peso |
|--------------|-----------------------------|--------|
| US912828M490 | T 1 7/8 10/31/22 | 26,81% |
| IT0004801541 | BTPS 5 1/2 09/01/22 | 15,53% |
| IT0005135840 | BTPS 1.45 09/15/22 | 10,59% |
| - | FUT EURO-BOBL FUTURE Sep22 | 7,28% |
| - | FUT US 5YR NOTE (CBT) Sep22 | 7,26% |

| Codice Isin | Titolo | Peso |
|--------------|----------------------------|--------|
| - | FUT S&P500 EMINI FUT Sep22 | 6,54% |
| - | FUT Euro-BTP Future Sep22 | 3,89% |
| IE00B5M4WH52 | ISHARES JP MOR EM LOC GOV | 3,52% |
| - | FUT EURO STOXX 50 Sep22 | 3,41% |
| - | FUT MSCI EmgMkt Sep22 | 3,03% |
| Totale | | 87,86% |

Composizione del portafoglio



I dati considerano anche l'esposizione derivante dall'eventuale utilizzo degli strumenti finanziari derivati, inclusi quelli presenti negli eventuali fondi sottostanti. L'investimento in depositi bancari a scadenza è incluso nell'asset class "Corporate".

| Depositi | Fondi e ETF di terzi | Peso | Duration |
|----------|----------------------|-------|----------|
| Depositi | Fondi e ETF di terzi | 3,52% | Comparto |
| | | | 1,54 |

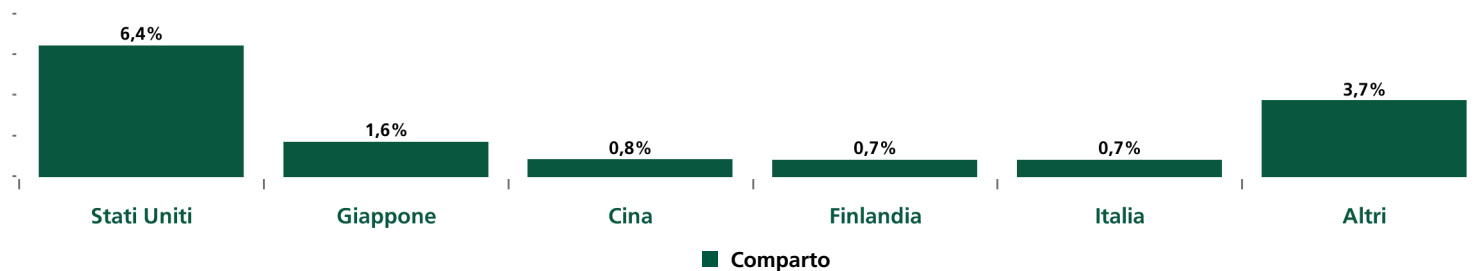
Include depositi bancari a scadenza e certificati di deposito

Investment Solutions by Epsilon - Multiasset Absolute

3 anni - 07-2016 R1

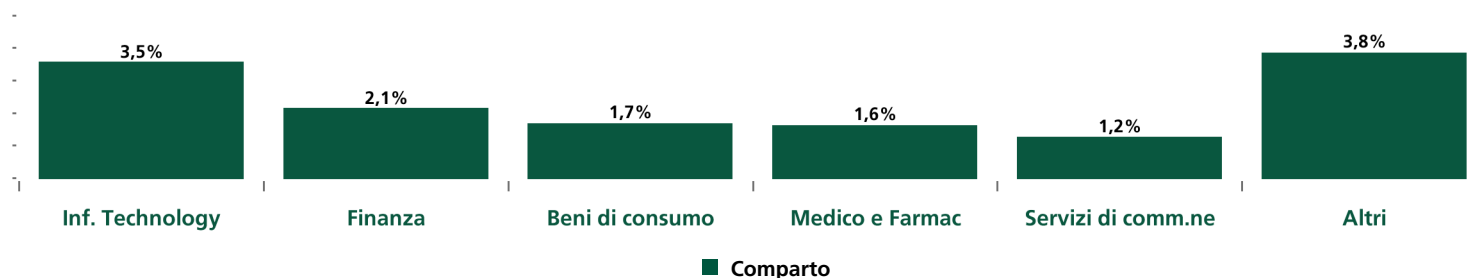
Dati al 30.06.2022

Esposizione azionaria geografica sul portafoglio complessivo



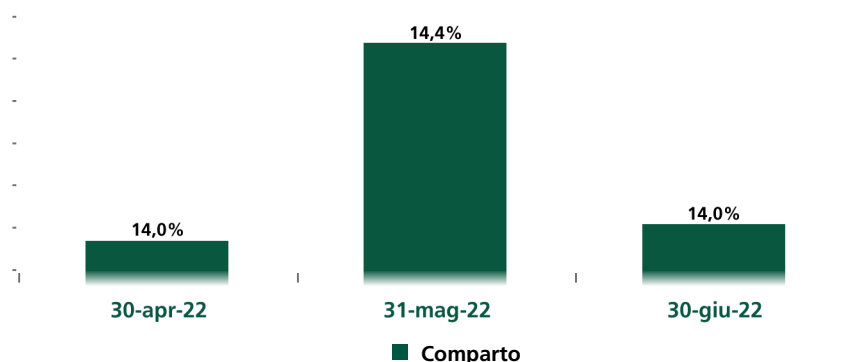
La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva azionaria, inclusi gli strumenti derivati (in particolare per gli Equity Asset Swap e per le Opzioni su azione è considerato il market value)

Esposizione azionaria settoriale sul portafoglio complessivo



La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva azionaria, inclusi gli strumenti derivati (in particolare per gli Equity Asset Swap e per le Opzioni su azione è considerato il market value)

Esposizione azionaria sul portafoglio complessivo negli ultimi mesi

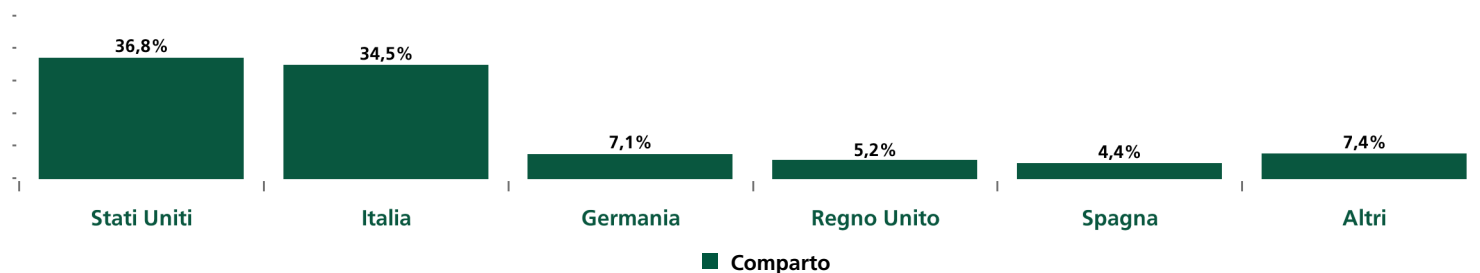


La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva azionaria, inclusi gli strumenti derivati.

| Ripartizione per rating emittente | Peso |
|-----------------------------------|--------|
| AAA | 7,12% |
| AA | 33,33% |
| A | 9,59% |
| BBB | 44,70% |
| BB | 0,22% |
| B | 0,01% |

Classificazione in base al rating Standard & Poor's.

Esposizione obbligazionaria geografica sul portafoglio complessivo



La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva obbligazionaria, inclusi gli strumenti derivati.

Investment Solutions by Epsilon - Multiasset Absolute

3 anni - 07-2016 R1

Dati al 30.06.2022



ALTRE INFORMAZIONI

Note anagrafiche

Nella gestione del fondo la SGR integra l'analisi dei rischi di sostenibilità nel proprio processo di investimento, ai sensi dell'art. 6 del Regolamento (UE) 2019/2088; per maggiori dettagli si veda la Politica di Sostenibilità.

Primo periodo d'investimento: 05.10.2016 - 04.10.2019
Secondo periodo d'investimento: 05.10.2019 - 04.10.2022

Delega di gestione

Epsilon SGR S.p.A.

Orizzonte temporale d'investimento

Questo Comparto potrebbe non essere indicato per gli investitori che prevedono di riscattare il proprio capitale entro 3 anni.

Periodo di sottoscrizione

05.07.2016 - 03.10.2016

ONERI

Importo minimo di sottoscrizione

500 euro

Spese di sottoscrizione

Non previste

Spese di rimborso

Max 1,38%

Spese correnti annue

1,11% (di cui provvigione di gestione max 1,00%)

Il valore delle spese correnti si basa sulle spese dell'anno precedente, concluso a dicembre 2021. Tale valore può variare da un anno all'altro ed esclude le commissioni legate al rendimento ed i costi delle operazioni di portafoglio.

Commissioni legate al rendimento

Le commissioni legate al rendimento sono calcolate in base alla metodologia descritta nel Prospetto e risultano pari al 20,00% della differenza positiva tra il rendimento eccedente il Valore Unitario della Quota più elevato raggiunto alla fine di ogni periodo di 12 mesi ed il rendimento del Bloomberg Barclays Euro Treasury Bill Index®+ 0,60% l'anno. La commissione di performance pagata lo scorso anno solare è stata pari al 0,00% del Comparto.

DISCLAIMER

Fonte: Elaborazione dati Eurizon Capital SGR S.p.A.

Per un maggior dettaglio informativo in merito alla politica di investimento concretamente posta in essere dal Fondo si raccomanda la lettura dell'ultimo rendiconto annuale di gestione.

Morningstar Rating™

© 2022 Morningstar. Tutti i diritti riservati. Le informazioni contenute nel presente documento: (1) sono di proprietà di Morningstar e/o dei suoi fornitori di contenuti; (2) non possono essere copiate o diffuse; e (3) non vi è alcuna garanzia che siano accurate, complete o aggiornate.

Né Morningstar né i suoi fornitori di contenuti sono responsabili di qualsiasi danno o perdita derivante da qualsiasi uso di queste informazioni. I risultati passati di Morningstar Rating non garantiscono quelli futuri. Per informazioni più dettagliate riguardo a Morningstar Rating, compresa la sua metodologia, si rimanda a: <https://shareholders.morningstar.com/investor-relations/governance/Compliance--Disclosure/default.aspx>

S&P Rating

Copyright 2022, Standard & Poor's Financial Services LLC. Reproduction of S&P Credit Ratings in any form is prohibited except with the prior written permission of Standard & Poor's Financial Services LLC (together with its affiliates, S&P). S&P does not guarantee the accuracy, completeness, timeliness or availability of any information, including ratings, and is not responsible for any errors or omissions (negligent or otherwise), regardless of the cause, or for the results obtained from the use of ratings. S&P GIVES NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, INCLUDING, BUT NOT LIMITED TO, ANY WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE. S&P shall not be liable for any direct, indirect, incidental, exemplary, compensatory, punitive, special or consequential damages, costs, expenses, legal fees, or losses (including lost income or profits and opportunity costs or losses caused by negligence) in connection with any use of Ratings. S&P's ratings are statements of opinions and are not statements of fact or recommendations to purchase, hold or sell securities. They do not address the market value of securities or the suitability of securities for investment purposes, and should not be relied on as investment advice.

Contatti

Eurizon Capital S.A.

Siège social: 28, boulevard Kockelscheuer - L-1821 Luxembourg - Boîte Postale 2062 - L-1020 Luxembourg - Téléphone +352 49 49 30.1 - Fax +352 49 49 30.349

Société Anonyme - R.C.S. Luxembourg N. B28536 - N. Matricule T.V.A. : 2001 22 33 923 - N. d'identification T.V.A. : LU 19164124 - N. I.B.L.C. : 19164124 - IBAN LU19 0024 1631 3496 3800

Società appartenente al Gruppo Bancario Intesa Sanpaolo, iscritto all'Albo dei Gruppi Bancari. Socio Unico: Eurizon Capital SGR S.p.A.

La presente comunicazione è diretta a fini informativi ai sottoscrittori dei fondi.

La presente informativa non costituisce una comunicazione di marketing né una raccomandazione o suggerimento, implicito o esplicito, rispetto ad una strategia di investimento avente oggetto strumenti finanziari, né una sollecitazione o offerta, né consulenza in materia di investimenti, legale, fiscale o di altra natura.

Investire comporta dei rischi: i rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. Il valore dell'investimento e il rendimento che ne deriva, sono soggetti a fluttuazioni, possono aumentare così come diminuire. Di conseguenza, i sottoscrittori dei fondi possono perdere tutto o parte del capitale inizialmente investito.

Prima di adottare qualsiasi decisione di investimento ed operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire è necessario leggere attentamente le Informazioni Chiave per gli Investitori (KIID), il Prospetto, il Regolamento di gestione e il Modulo di sottoscrizione. Tali documenti descrivono i diritti degli investitori, la natura di questo Fondo, i costi ed i rischi ad esso connessi e sono disponibili gratuitamente sul sito internet www.eurizoncapital.com nonché presso i distributori. È inoltre possibile ottenere copie cartacee di questi documenti previa richiesta scritta alla Società di gestione del Fondo o alla Banca Depositaria. I KIID sono disponibili nella lingua ufficiale locale del paese di distribuzione. Il Prospetto è disponibile in italiano e inglese. La Società di Gestione può decidere di porre fine alle disposizioni adottate per la commercializzazione dei suoi organismi di investimento collettivo in conformità all'art. 93 bis della direttiva 2009/65/CE e all'art. 32 bis della direttiva 2011/61/UE.

La Società di Gestione non si assume alcuna responsabilità per l'uso improprio delle informazioni contenute nel presente materiale informativo.

Il contenuto della presente comunicazione riporta dati puntuali ed elaborazioni relative alla data in esso indicata.

La performance del Comparto riflette gli oneri gravanti sullo stesso ed è al lordo degli oneri fiscali vigenti.