

# Eurizon Soluzione ESG 40 Classe A

Dati al 28.02.2023



## Categoria Assogestioni

Bilanciati

Inizio collocamento 14.04.1998

Patrimonio (EUR) 772 mil.

Valore quota (EUR) 9,208

Morningstar Rating <sup>TM</sup> ★★★

ISIN IT0001080388

## Nome del gestore

L. Calcante

E. Martuscelli

G. Petrillo

## Benchmark

10% Bloomberg Euro Treasury Bill;  
40% JP Morgan Emu Government Bond Index;  
10% Bloomberg Euro Aggregate Corporate;  
40% MSCI All Countries World in euro

Il Fondo non si propone di replicare la composizione del benchmark.

## Profilo di rischio e di rendimento

RISCHIO PIU' BASSO

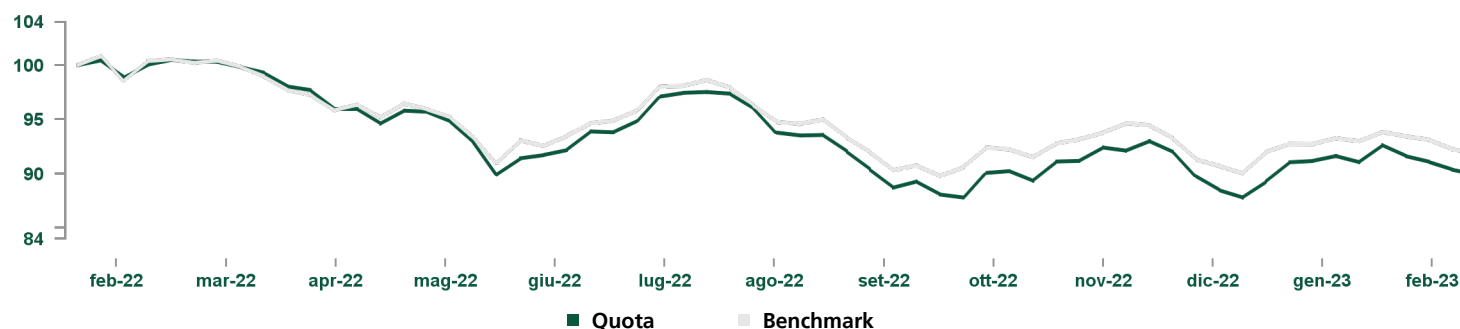
RISCHIO PIU' ELEVATO



L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 5 anni. L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra incapacità di pagarvi quanto dovuto. Abbiamo classificato questo prodotto al livello 3 su 7, che corrisponde alla classe di rischio medio-bassa.

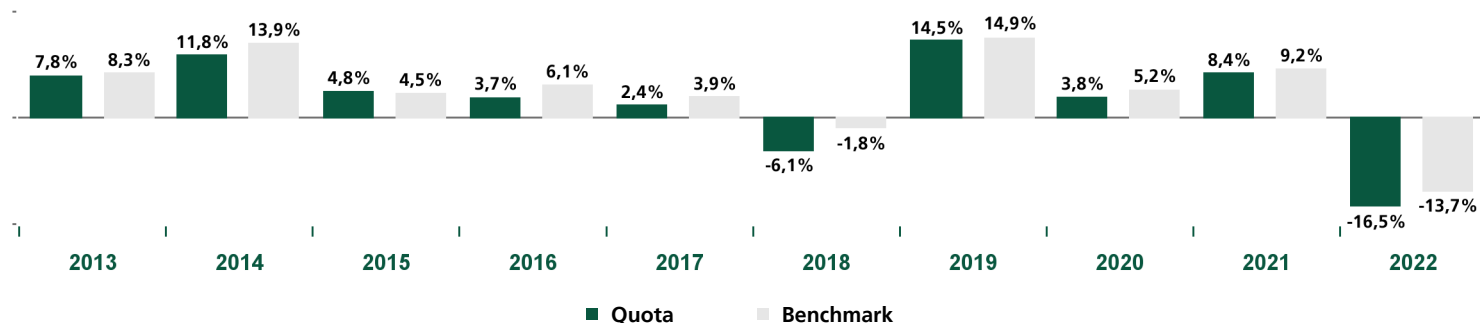
Per maggiori dettagli in relazione ai rischi derivanti dalla sottoscrizione di questo prodotto si consulti il KID o il Prospetto.

## Andamento del valore della quota del fondo e del benchmark



Rendimenti	1 mese	3 mesi	Da inizio anno	1 anno	3 anni
Quota	-1,3%	-2,4%	2,4%	-10,1%	-1,2%
Benchmark	-1,2%	-3,0%	2,0%	-8,2%	2,7%

## Rendimento annuo del fondo e del benchmark



Il benchmark è variato nel corso degli anni.

# Eurizon Soluzione ESG 40 Classe A

Dati al 28.02.2023



Rendimento del fondo e del benchmark al 31.12.2022	Quota	Benchmark
Rendimento ultimi 12 mesi	-16,5%	-13,7%
Rendimento medio annuo composto ultimi 3 anni	-2,1%	-0,3%
Rendimento medio annuo composto ultimi 5 anni	0,2%	2,3%

Dati aggiornati all'ultimo trimestre solare concluso

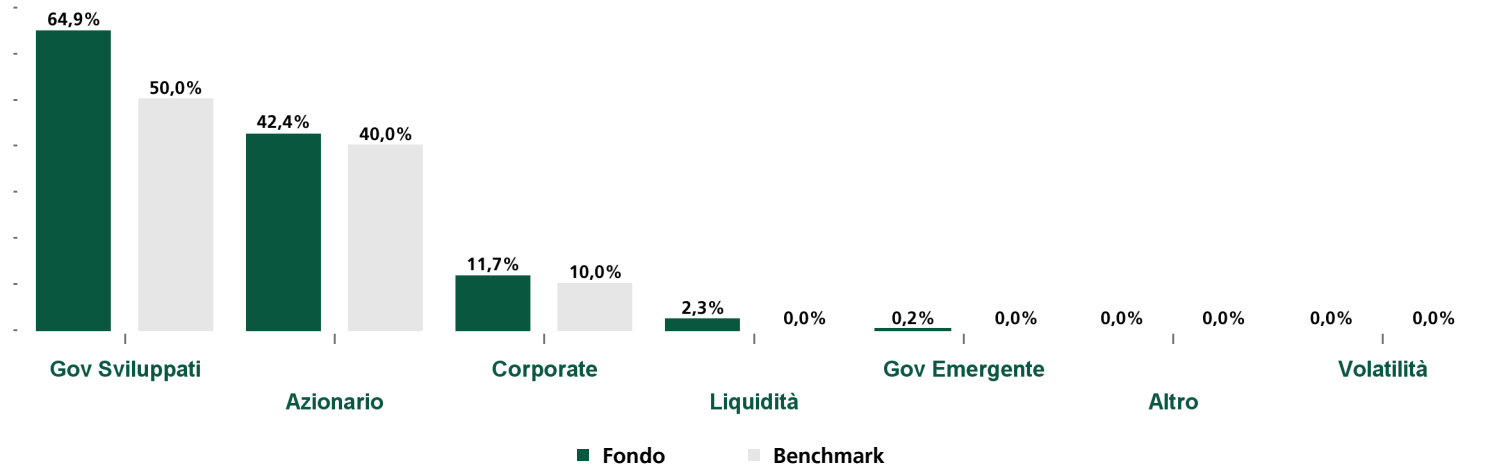
Misure statistiche <sup>1</sup>	1 anno
Volatilità	10,79%
Tracking Error Volatility	3,01%
Sharpe Ratio	-0,91

## Principali strumenti finanziari in portafoglio (escluso liquidità)

Codice ISIN	Strumento finanziario	Peso
LU0335987854	EF BOND EUR LONG TERM CL Z LTE	13,00%
-	FUT US 2YR NOTE (CBT) Jun23	7,70%
LU0278427041	EPS FUND EURO BOND CL I	5,53%
LU0335987698	EF BOND EUR MEDIUM TERM CL Z LTE	5,06%
LU0335987268	EF BOND EUR SHORT TERM LTE	4,61%

Codice ISIN	Strumento finanziario	Peso
LU2050471072	EURIZON-EQUITY USA ESG LTE-Z	4,23%
LU0335987003	EF CASH EUR CL Z	4,18%
LU0719365891	EF BOND CORPORATE EUR CL Z	3,96%
IT0005489809	Epsilon US Equity ESG Index CI I	3,77%
-	FUT US 10YR NOTE (CBT)Jun23	3,38%
Totale		55,43%

## 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	
Depositi	-

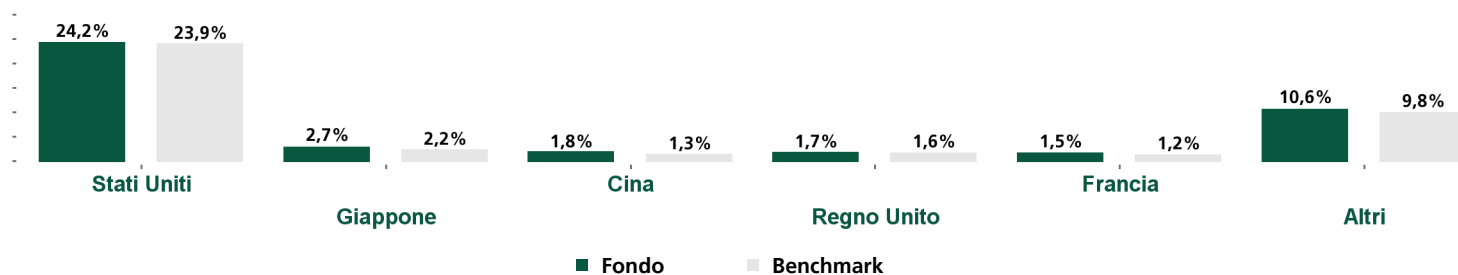
Incluse depositi bancari a scadenza e certificati di deposito

Fondi e ETF di terzi	Peso
Fondi e ETF di terzi	25,84%

Duration	
Fondo	4,15
Benchmark	3,30

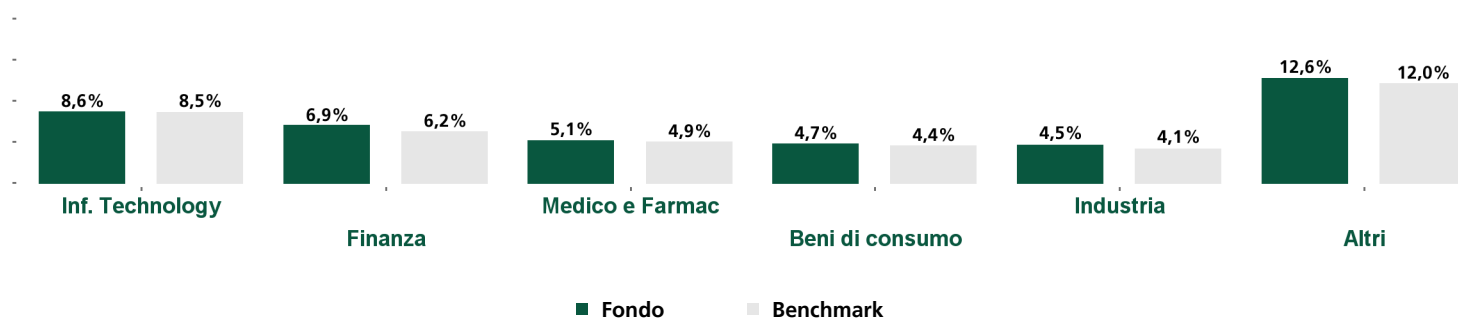
<sup>1</sup> Volatilità: la volatilità di un fondo comune di investimento indica la variabilità del rendimento del fondo nel tempo e rappresenta quindi la tendenza dei valori della quota a discostarsi dal valore medio (della quota) nel periodo considerato.  
Tracking Error Volatility: la misura descrive la volatilità dei rendimenti differenziali di un fondo rispetto ad un indice di riferimento.  
Sharpe Ratio: l'indice di Sharpe è un indicatore di performance corretta per il rischio. Esso individua il maggiore (o minore) rendimento registrato dal fondo rispetto all'investimento privo di rischio e lo rapporta al rischio sostenuto ed espresso dalla deviazione standard. Si assume come Indice Free Risk il Bloomberg Euro Treasury Bills Index.

## Esposizione azionaria geografica sul portafoglio complessivo



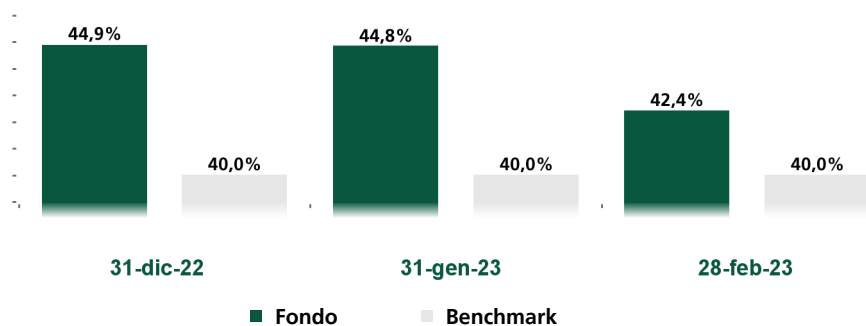
La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva azionaria, inclusi gli strumenti derivati (in particolare per gli Equity Asset Swap e per le Opzioni su azione è considerato il market value)

## 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)

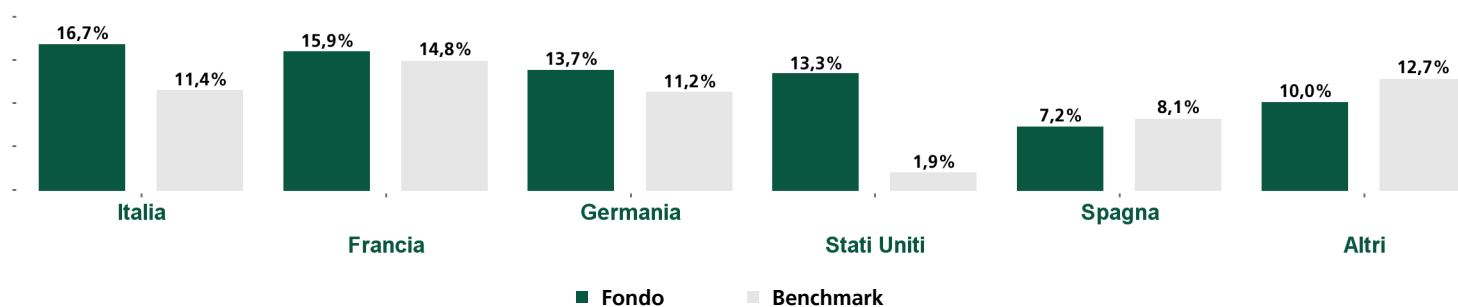
## Esposizione azionaria sul portafoglio complessivo negli ultimi mesi



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

Esposizione per Rating S&P	Peso
AAA	13,73%
AA	29,33%
A	10,17%
BBB	21,18%
BB	0,65%
B	0,10%
Inferiore a B	0,01%

## Esposizione obbligazionaria per paese emittente



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

# Eurizon Soluzione ESG 40 Classe A

Dati al 28.02.2023



## ALTRE INFORMAZIONI

### Note anagrafiche

Il Fondo si qualifica ai sensi dell'art. 8 del Regolamento (UE) 2019/2088; per maggiori dettagli si veda l'Informativa sulla Sostenibilità.

Fino al 30/06/2020 la denominazione del Fondo era Eurizon Soluzione 40.  
In data 27/05/2022 ha incorporato i fondi Eurizon AM Bilanciato Euro a Rischio Controllato, Eurizon AM Global Multifund 50.

## ONERI

### Sottoscrizione iniziale minima

50 euro

### Spese di sottoscrizione

Max 1,50%

### Spese di rimborso

Non previste

### Spese correnti annue

1,61% (di cui provvigione di gestione 1,35%)

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

Nell'ultimo esercizio, la commissione legata al rendimento è stata pari allo 0,00% del Fondo.  
La commissione legata al rendimento a favore della SGR è pari al 20% della differenza maturata nell'anno solare tra l'incremento percentuale del valore della quota e l'incremento percentuale del valore del parametro di riferimento (vedi benchmark).

## 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™

MORNINGSTAR è un fornitore indipendente di analisi degli investimenti. © 2023 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>

### Rating S&P

Copyright 2023, 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 SGR S.p.A.

Sede Legale: Piazzetta Giordano dell'Amore, 3 - 20121 Milano - Italia Tel. +39 02 8810.1 - Fax +39 02 8810 65 00  
Capitale sociale euro 99.000.000,00 i.v. - Codice Fiscale e Iscrizione Registro Imprese di Milano n. 04550250015 - Società partecipante al Gruppo IVA "Intesa Sanpaolo", Partita IVA 11991500015 (IT11991500015) - Iscritta all'Albo delle SGR, al n. 3 nella Sezione Gestori di OICVM e al n. 2 nella Sezione Gestori di FIA - Società soggetta all'attività di direzione e coordinamento di Intesa Sanpaolo S.p.A. ed appartenente al Gruppo Bancario Intesa Sanpaolo, iscritto all'Albo dei Gruppi Bancari. Socio Unico: Intesa Sanpaolo S.p.A. - Aderente al Fondo Nazionale di Garanzia

### 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 il Documento contenente le Informazioni Chiave (KID), 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](http://www.eurizoncapital.com) nonché presso i distributori. È inoltre possibile ottenere copie cartacee di questi documenti presso la Società di gestione del Fondo su richiesta. I documenti citati sono disponibili in italiano.

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 Fondo riflette gli oneri gravanti sullo stesso e non contabilizzati nell'andamento del benchmark. Le performance del Fondo e del benchmark sono al lordo degli oneri fiscali vigenti.