

Epsilon Flessibile 20

Dati al 30.04.2023



Categoria Assogestioni

Flessibili

Inizio collocamento

09.07.2013

Patrimonio (EUR)

328 mil.

Valore quota (EUR)

4,838

Morningstar Rating TM

★★

ISIN

IT0004921141

Nome del gestore

Andrea Mambretti

VaR

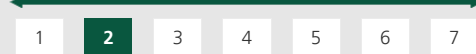
-3,30%

Tale descrizione di rischio consente di quantificare la perdita massima potenziale che il portafoglio del Fondo può subire su un orizzonte temporale di un mese con un livello di probabilità del 99%.

Profilo di rischio e di rendimento

RISCHIO PIU' BASSO

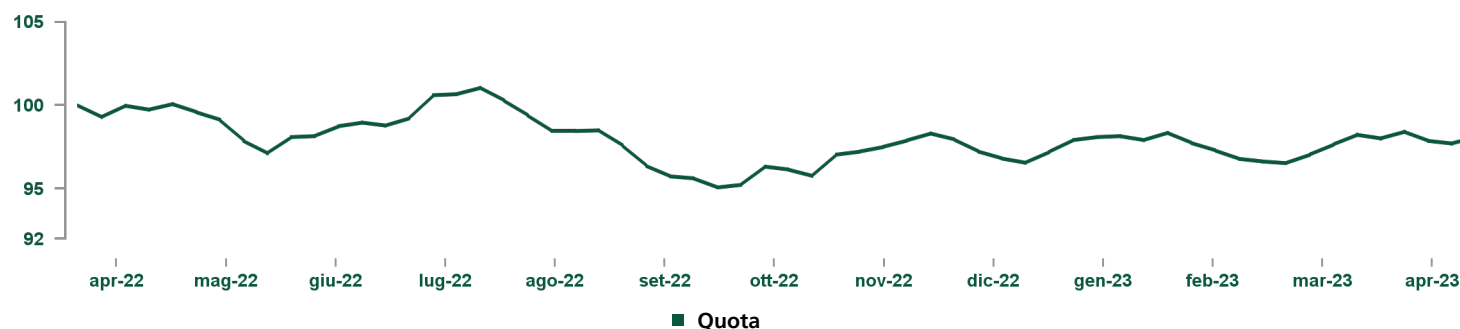
RISCHIO PIU' ELEVATO



L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto per 4 anni.

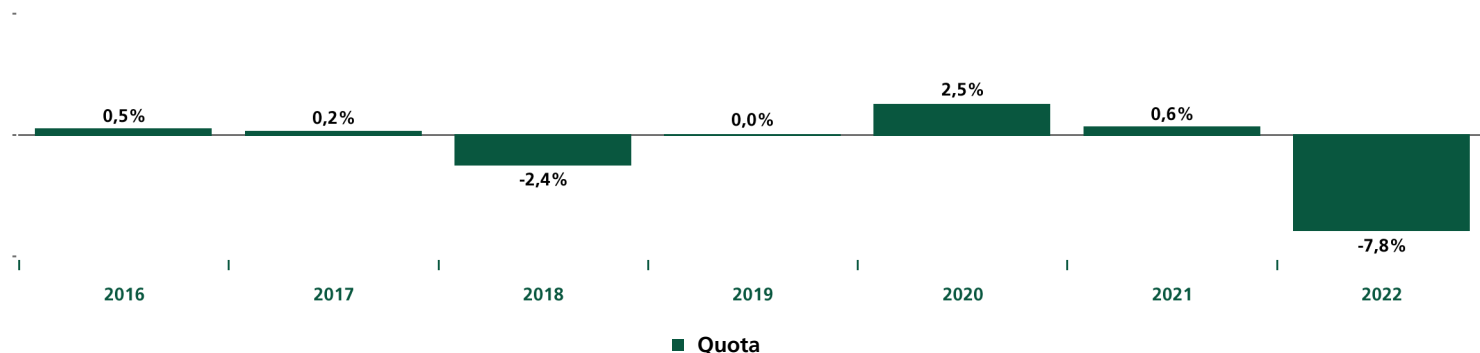
Per maggiori informazioni, si prega di far riferimento alla sezione "Informazioni sul profilo di rischio".

Andamento del valore della quota del fondo



Rendimenti	1 mese	3 mesi	Da inizio anno	1 anno	3 anni
Quota	0,1%	0,2%	1,6%	-1,9%	-2,7%

Rendimento annuo del fondo



Dal 3 luglio 2019 è variata la politica di investimento del Fondo.

Epsilon Flessibile 20

Dati al 30.04.2023



Rendimento del fondo al 31.03.2023	Quota
Rendimento ultimi 12 mesi	-3,4%
Rendimento medio annuo composto ultimi 3 anni	-0,5%
Rendimento medio annuo composto ultimi 5 anni	-1,1%

Dati aggiornati all'ultimo trimestre solare concluso

Dal 3 luglio 2019 è variata la politica di investimento del Fondo.

Principali strumenti finanziari in portafoglio (escluso liquidità)

Codice ISIN	Strumento finanziario	Peso
-	FUT US 2YR NOTE (CBT) Jun23	16,02%
-	FUT US 10YR NOTE (CBT)Jun23	9,02%
IT0005514473	BTPS 3 1/2 01/15/26	7,75%
IT0005499311	BTPS 1 3/4 05/30/24	7,12%
IT0005437147	BTPS 0 04/01/26	4,16%

Misure statistiche ¹	1 anno
Volatilità	4,78%
Sharpe Ratio	-0,47

Codice ISIN	Strumento finanziario	Peso
IT0005454241	BTPS 0 08/01/26	2,47%
-	FUT NIKKEI 225 (OSE) Jun23	2,35%
-	FUT S&P500 EMINI FUT Jun23	2,15%
-	FUT MSCI EmgMkt Jun23	2,09%
-	FUT EURO-BUND FUTURE Jun23	2,04%
Totale		55,16%

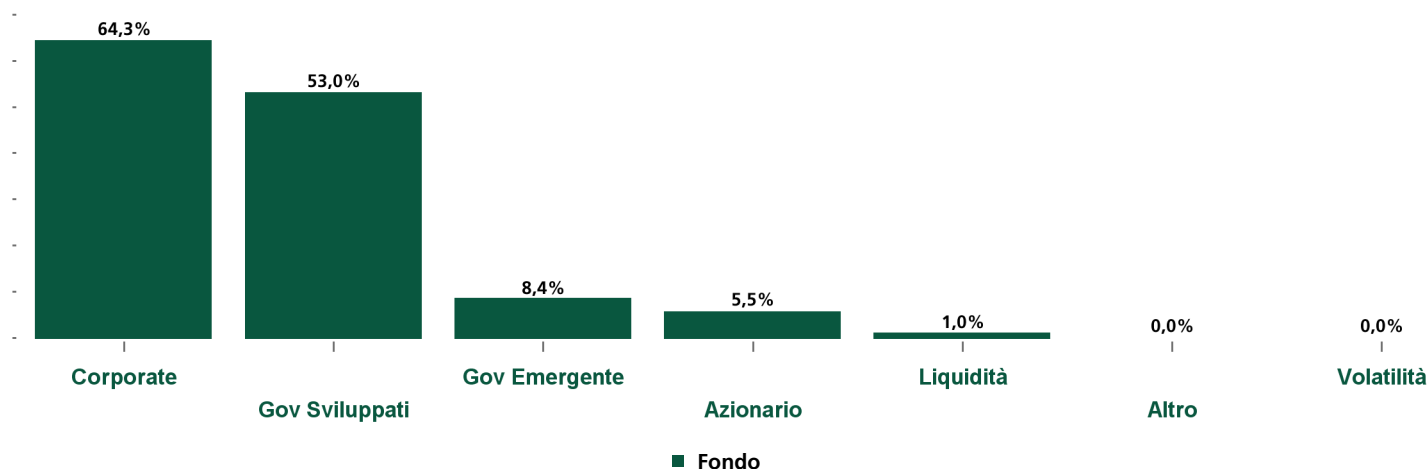
¹ Volatilità: la volatilità di un fondo comune di investimento indica la variabilità del rendimento del fondo nel tempo e rappresenta quindi la tendenza dei valori della quota a discostarsi dal valore medio (della quota) nel periodo considerato.

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.

Epsilon Flessibile 20

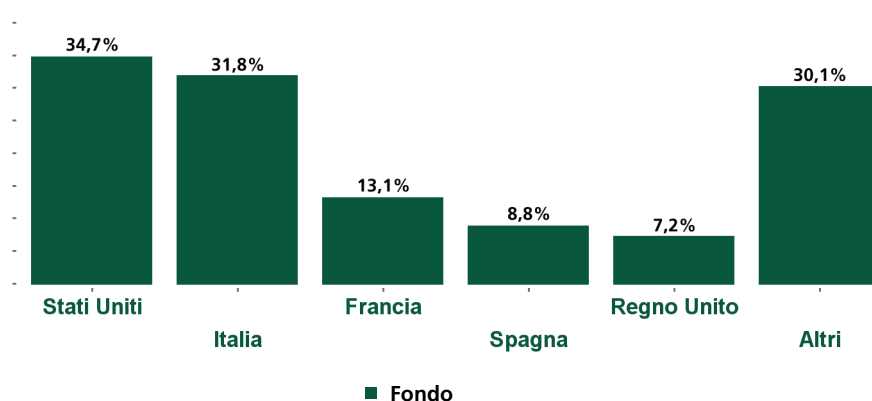
Dati al 30.04.2023

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".

Esposizione obbligazionaria per paese emittente



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

Esposizione per Rating S&P	Peso
AAA	11,03%
AA	28,56%
A	19,36%
BBB	52,86%
BB	6,65%
B	0,43%

Depositi

Depositi -

Include depositi bancari a scadenza e certificati di deposito

Fondi e ETF di terzi

Fondi e ETF di terzi

Peso

-

Duration

Fondo

2,86

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.

Fino al 02/07/2019 la denominazione del Fondo era Epsilon Flexible Forex Coupon Settembre 2018. Dal 03/07/2019 è variata la politica di investimento del Fondo.

ONERI

Sottoscrizione iniziale minima

500 euro

Spese di sottoscrizione

Max 0,50%

Spese di rimborso

Non previste

Spese correnti annue

1,07% (di cui provvigione di gestione 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

Tra il 1° agosto 2021 ed il 31 luglio 2022, la commissione legata al rendimento è stata pari allo 0,00% del Fondo. La commissione legata al rendimento è pari al 15% del minor valore maturato nell'anno solare (1° gennaio - 31 dicembre di ogni anno) tra:

- l'incremento percentuale del valore della quota del Fondo rispetto al più elevato valore registrato dalla stessa nell'ultimo giorno di valorizzazione degli anni solari precedenti;
- la differenza tra l'incremento percentuale del valore della quota del Fondo e l'incremento percentuale del valore del seguente parametro di riferimento nell'anno solare: Bloomberg Euro Treasury Bill + 0,90%.

Informazioni sul profilo di rischio

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 2 su 7, che corrisponde alla classe di rischio bassa.

Ciò significa che le perdite potenziali dovute alla performance futura del prodotto sono classificate nel livello basso e che è molto improbabile che le cattive condizioni di mercato influenzino la capacità di rimborsare il capitale investito.

Questo prodotto non comprende alcuna protezione dalla performance futura del mercato; pertanto potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso.

Per ogni ulteriore dettaglio sui rischi dell'investimento, si prega di consultare la sezione Rischi del Prospetto del Fondo.

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

Epsilon SGR S.p.A.

Sede Legale: Piazzetta Giordano dell'Amore, 3 - 20121 Milano - Italia Tel. +39 02 8810.8820 - Fax +39 02 7005.7447

Capitale Sociale euro 5.200.000 i.v. - Codice Fiscale e Iscrizione Registro Imprese di Milano n. 11048700154 - Società partecipante al Gruppo IVA "Intesa Sanpaolo", Partita IVA 11991500015

(IT11991500015) - Iscritta all'Albo delle SGR, Sezione Gestori di OICVM n. 22 - Società soggetta all'attività di direzione e coordinamento di Intesa Sanpaolo S.p.A. e appartenente al Gruppo Bancario Intesa Sanpaolo, iscritto all'Albo dei Gruppi Bancari - Socio Unico: Eurizon Capital SGR 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 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.

I dati di rendimento del Fondo non includono i costi di sottoscrizione a carico dell'investitore. La performance del Fondo riflette gli oneri gravanti sullo stesso ed è al lordo degli oneri fiscali vigenti.