

Epsilon Multiasset Valore Globale Settembre 2021 Classe A



Dati al 28.02.2021

Categoria Assogestioni	Flessibili
Inizio collocamento	28 giugno 2016
Patrimonio netto	108 mil. euro
Valore quota	5,053 euro
Morningstar Rating™	Senza Rating
ISIN	IT0005199663

Nome del gestore Maria Bruna Riccardi
Cesare Orsini

VaR
-5,40%
Tale misura 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/rendimento del fondo

RISCHIO PIU' BASSO RISCHIO PIU' ELEVATO

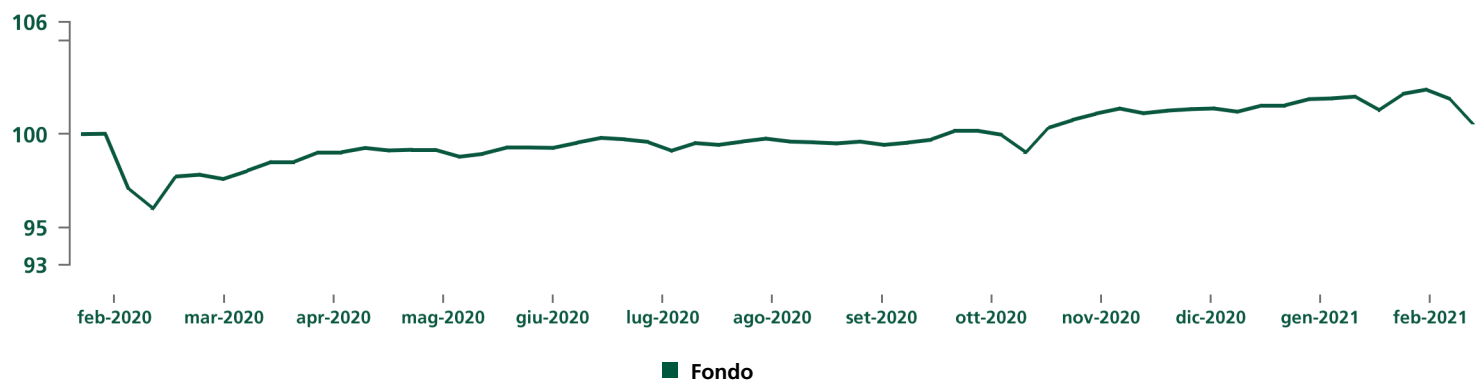
←----->

Rendimento potenzialmente più basso Rendimento potenzialmente più elevato

1 2 3 **4** 5 6 7

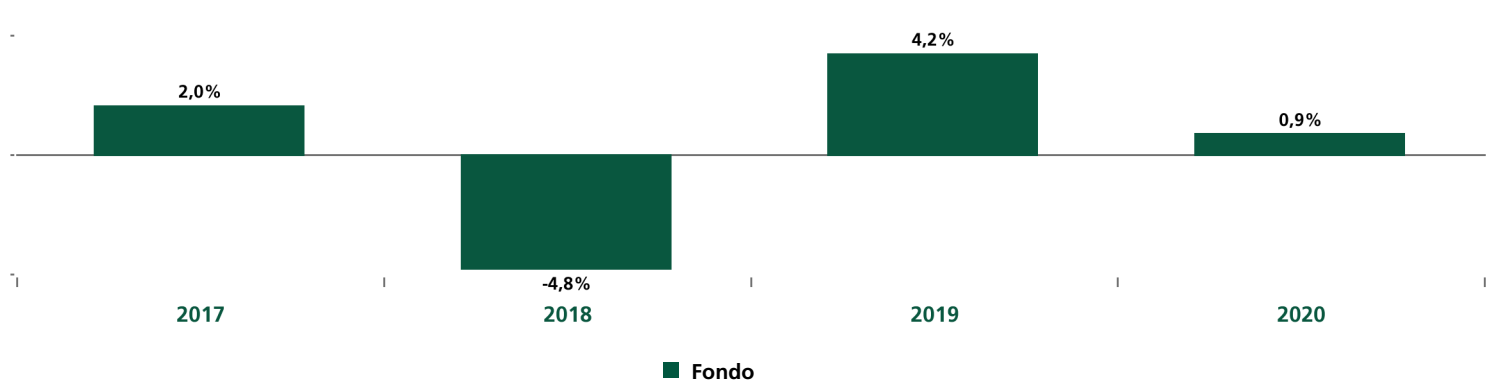
I dati storici utilizzati per calcolare l'indicatore sintetico potrebbero non costituire un'indicazione affidabile circa il futuro profilo di rischio del Fondo. La categoria di rischio/rendimento indicata potrebbe non rimanere invariata, e quindi la classificazione del Fondo potrebbe cambiare nel tempo.

Andamento del valore della quota del fondo



Rendimenti	1 mese	3 mesi	Da inizio anno	1 anno	3 anni
Fondo	-0,7%	-0,5%	-0,9%	0,6%	-0,7%

Rendimento annuo del fondo



Messaggio pubblicitario con finalità promozionale.

Prima dell'adesione si raccomanda di leggere attentamente le Informazioni Chiave per gli Investitori (KIID) ed il Prospetto disponibili sul sito internet della SGR www.epsilonmgr.it, nonché presso i distributori, per conoscere la natura di questo Fondo, i costi ed i rischi ad esso connessi ed operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire. I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. 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.

Epsilon Multiasset Valore Globale Settembre 2021

Classe A



Dati al 28.02.2021

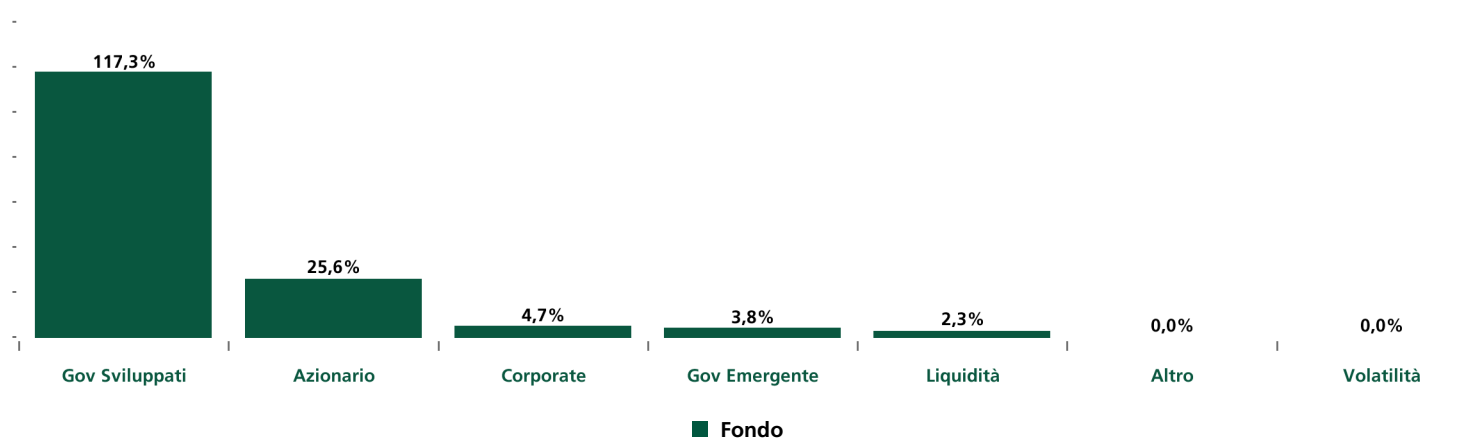
Rendimento del fondo al 31.12.2020		Fondo	Misure statistiche ¹		1 anno
Rendimento ultimi 12 mesi		0,9%	Volatilità		4,69%
Rendimento medio annuo composto ultimi 3 anni		0,0%	Sharpe Ratio		0,22
Rendimento medio annuo composto ultimi 5 anni		-			

Dati aggiornati all'ultimo trimestre solare concluso

Principali strumenti finanziari in portafoglio

Codice Isin	Titolo	Peso	Codice Isin	Titolo	Peso
-	FUT EURO-BUND FUTURE Mar21	20,84%	IT0005244782	BTPS 1.2 04/01/22	9,44%
-	FUT US 5YR NOTE (CBT) Jun21	19,92%	-	FUT S&P500 EMINI FUT Mar21	8,99%
IT0005086886	BTPS 1.35 04/15/22	9,94%	IT0005388928	ICTZ 0 11/29/21	8,90%
-	FUT US 10YR NOTE (CBT)Jun21	9,90%	IT0005028003	BTPS 2.15 12/15/21	8,24%
IT0005175598	BTPS 0.45 06/01/21	9,46%	US9128285760	T 1 1/8 07/31/21	6,35%
Totale					111,98%

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	2,70%	Fondo
-			4,16

Include depositi bancari a scadenza e certificati di deposito

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 Barclays Euro Treasury Bills Index.

Messaggio pubblicitario con finalità promozionale.

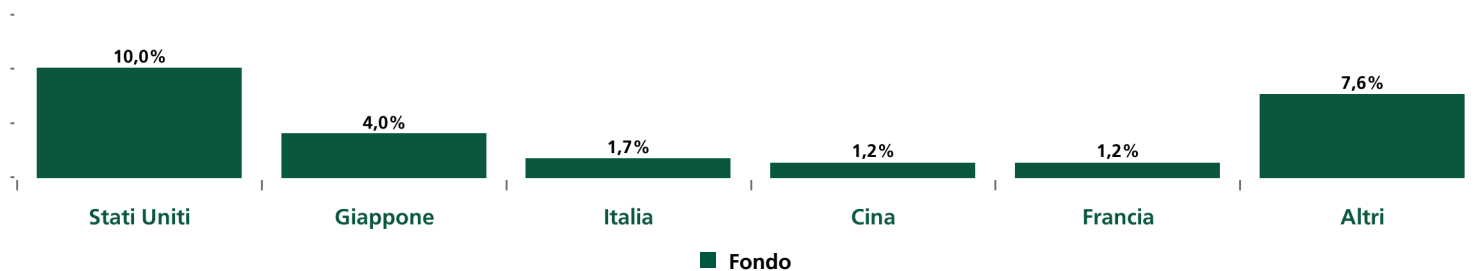
Prima dell'adesione si raccomanda di leggere attentamente le Informazioni Chiave per gli Investitori (KIID) ed il Prospetto disponibili sul sito internet della SGR www.epsilonmgr.it, nonché presso i distributori, per conoscere la natura di questo Fondo, i costi ed i rischi ad esso connessi ed operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire. I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. 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.

Epsilon Multiasset Valore Globale Settembre 2021 Classe A

Dati al 28.02.2021

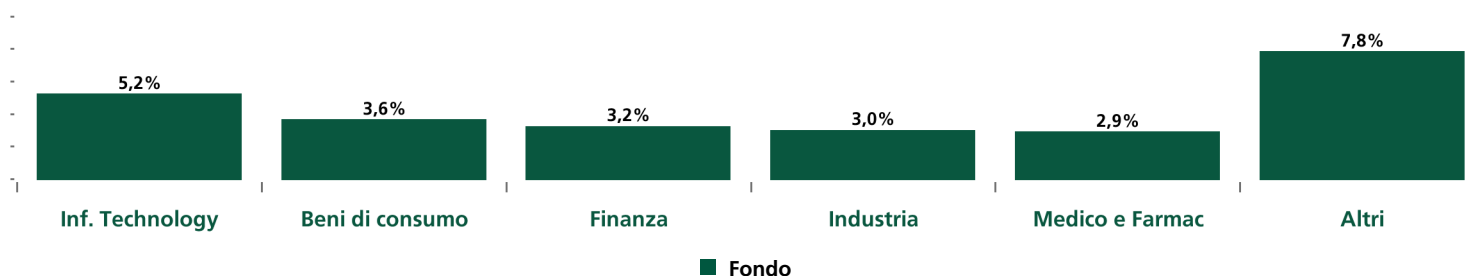


Esposizione azionaria geografica sul portafoglio complessivo



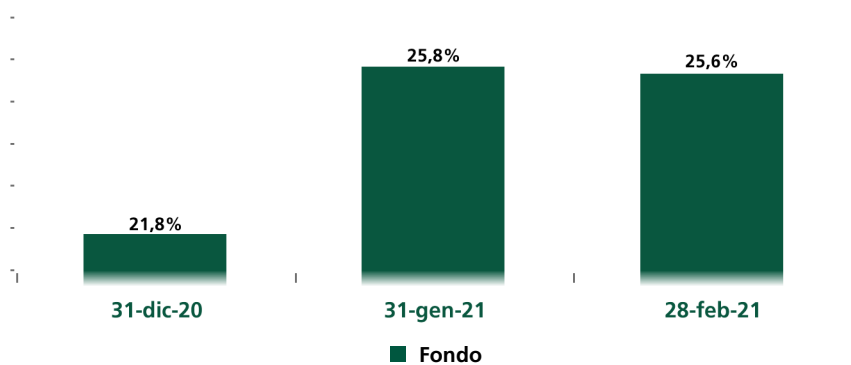
La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva azionaria, inclusi gli strumenti derivati (in particolare per gli Equity Asset Swap e per le Opzioni su azione è considerato il market value)

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

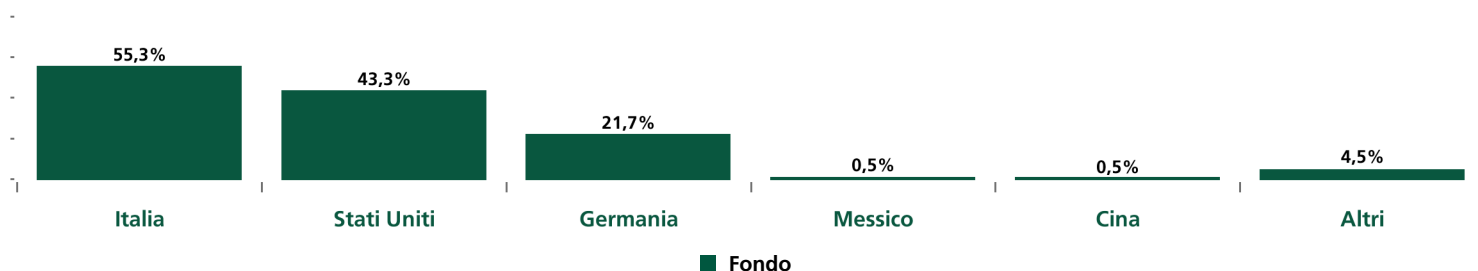


La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva azionaria, inclusi gli strumenti derivati.

Ripartizione per rating emittente	Peso
AAA	21,01%
AA	42,34%
A	1,25%
BBB	58,89%
BB	0,97%
B	0,44%
Inferiore a B	0,06%

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.

Messaggio pubblicitario con finalità promozionale.

Prima dell'adesione si raccomanda di leggere attentamente le Informazioni Chiave per gli Investitori (KIID) ed il Prospetto disponibili sul sito internet della SGR www.epsilonmgr.it, nonché presso i distributori, per conoscere la natura di questo Fondo, i costi ed i rischi ad esso connessi ed operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire. I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. 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.

Epsilon Multiasset Valore Globale Settembre 2021

Classe A

Dati al 28.02.2021



ALTRE INFORMAZIONI

Orizzonte temporale d'investimento	Questo Fondo potrebbe non essere indicato per gli investitori che prevedono di ritirare il proprio capitale entro 5 anni ovvero prima della scadenza del ciclo di investimento del Fondo.
Periodo di sottoscrizione	28.06.2016 - 20.09.2016
Periodo di investimento	21.09.2016 - 30.09.2021
Periodo di post-investimento	Da 01.10.2021

ONERI

Importo minimo di sottoscrizione	500 euro
Spese di sottoscrizione	Non previste
Spese di rimborso	Max 2,00%
Spese correnti annue	1,81% (di cui provvigione di gestione 1,35%) Il valore delle spese correnti si basa sulle spese dell'anno precedente, concluso a dicembre 2020. 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% del minor valore maturato nel periodo intercorrente tra il 1° ottobre di ogni anno ed il 30 settembre dell'anno successivo (di seguito "esercizio contabile") tra: - l'incremento percentuale del valore della quota del Fondo rispetto al più elevato valore registrato dalla stessa nell'ultimo giorno di valorizzazione degli esercizi contabili precedenti; - la differenza tra l'incremento percentuale del valore della quota del Fondo e l'incremento percentuale del valore del parametro di riferimento (Bloomberg Barclays Euro Treasury Bills Index + 2,00%) nell'esercizio contabile.

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™

2021 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar e (2) non possono essere copiate.

Le informazioni non devono essere utilizzate senza un'adeguata verifica da parte dell'utilizzatore e, se opportuno, un parere professionale. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi legge concorda che le informazioni fornitegli da Morningstar, eventualmente tramite il Licenziatario, vengono usate a rischio e pericolo dell'utilizzatore stesso. Non vi è garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

S&P Rating

Copyright 2021, 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.

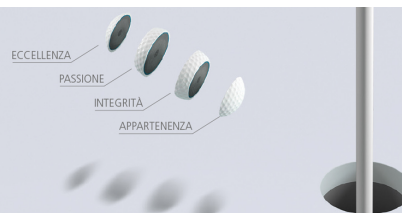
Contatti

Epsilon SGR S.p.A.

Sede Legale: Piazzetta Giordano dell'Amore, 3 - 20121 Milano - Italia Tel. +39 02 8810.2070 - 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

Ogni performance
è il risultato dei nostri valori.



Messaggio pubblicitario con finalità promozionale.

Prima dell'adesione si raccomanda di leggere attentamente le Informazioni Chiave per gli Investitori (KIID) ed il Prospetto disponibili sul sito internet della SGR www.epsilonmgr.it, nonché presso i distributori, per conoscere la natura di questo Fondo, i costi ed i rischi ad esso connessi ed operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire. I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. 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.