

Epsilon Fund - Enhanced Constant Risk Contribution Class Unit R EUR

Categoria Morningstar™
Accumulation

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

★★

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

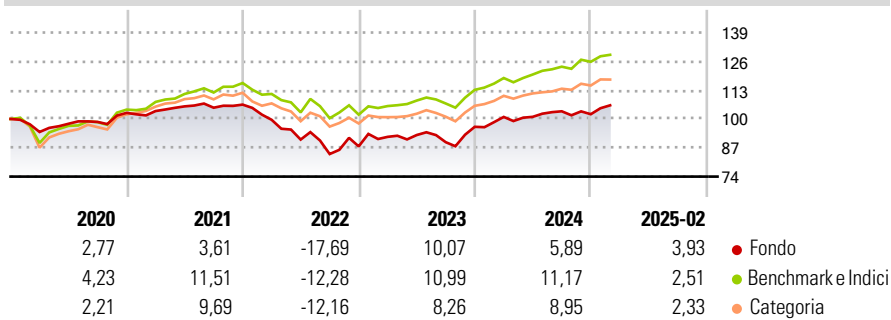
The objective of this Sub-Fund is to achieve an absolute investment return in Euro. This Sub-Fund is managed through quantitative methods aiming at maintaining the risk allocation between the two asset classes to which it is exposed (equity instruments and debt instruments) aligned with the target values defined by the Investment Manager ("Constant Risk Contribution" model). The exposure is modulated by the Investment Manager so as to maximize the expected return of the Sub-Fund ("Tactical Overlay"). No guarantee is given to investors in this Sub-Fund with respect to the objective actually being reached.

Misure di Rischio

3Y Alpha	-3,99	3Y Sharpe Ratio	-0,04
3Y Beta	1,18	3Y Std Dev	10,84
3Y R-Squared	85,39	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,86	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,37	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0,49	-3,50	-2,53	2025	-	-	-	-
6-Mesi	2,00	1,37	2,97	2025	4,62	0,04	2,47	-1,26
1-Anno	4,10	5,79	5,37	2024	4,90	0,89	-3,48	7,76
3-Anni Ann.ti	1,51	4,27	3,38	2023	-6,44	-8,96	-7,18	4,10
5-Anni Ann.ti	1,39	6,07	5,02	2022	0,78	2,04	-0,57	1,33
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021				

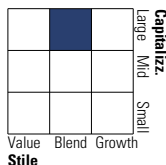
Rendimenti aggiornati al 10/03/2025

Portafoglio 31/12/2024



Morningstar Style Box®

Stile Azionario



Reddito Fisso

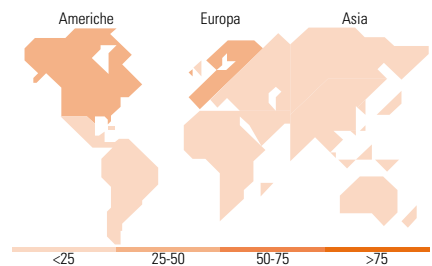


Distribuzione Settoriale %

	Fondo
Ciclico	36,94
Sensibile	47,04
Difensivo	16,03

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	82,96
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	17,04
Derivati	0,00



Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	38,64
Stati Uniti	36,86
Canada	0,90
America Latina e Centrale	0,87
Europa	50,54
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	48,64
Europa Occidentale - Non Euro	0,31
Europa dell'Est	0,26
Africa	0,39
Medio Oriente	0,95
Asia	10,82
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	3,90
Asia - Emergente	6,92

Titoli principali

Nome	Settore	%
MSCI Emerging Markets Index...	-	9,83
Apple Inc		2,91
Italy (Republic Of)	-	2,50
Spain (Kingdom of)	-	2,24
ASML Holding NV		2,09
SAP SE		2,04
Microsoft Corp		1,95
Spain (Kingdom of)	-	1,93
Spain (Kingdom of)	-	1,87
Italy (Republic Of)	-	1,80
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		29,18
Numero Complessivo di Titoli Azionari		190
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		31

Anagrafica

Società di Gestione	Eurizon Capital S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	6,34 EUR	Investimento Min. Ingresso	500 EUR
Telefono	352494930303	(10/03/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.eurizoncapital.lu	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	29/03/2016	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,71%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	1,50%
Data Inizio Gestione	03/10/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (10/03/2025)	EUR 114,90	ISIN	LU1350857071		
Patrimonio Netto (Mln)	27,46 EUR				

(31/12/2024)