

# Epsilon Fund - Enhanced Constant Risk Contribution Class Unit RD EUR

**Categoria Morningstar™**  
**Distribuzione** Globali

**Benchmark Morningstar**

Morningstar Euro Moderate Global Target

**Benchmark Dichiarato**

Not Benchmarked

**Morningstar Rating™**

★★

Allocation NR EUR

Usato nel Report

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

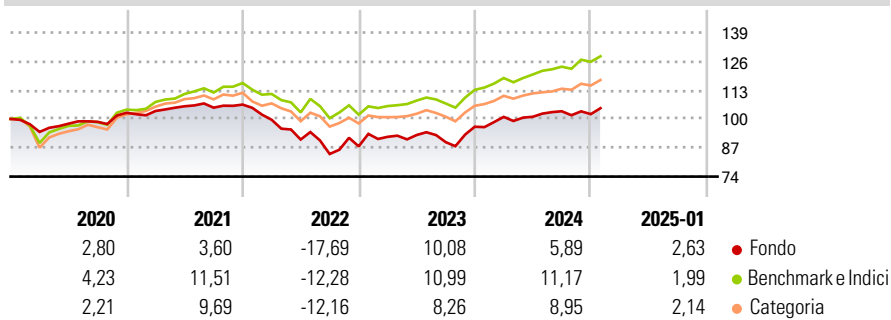
The objective of this Sub-Fund is to achieve an absolute investment return in Euro. This Sub-Fund is managed through quantitative methods aiming at maintaining the risk allocation between the two asset classes to which it is exposed (equity instruments and debt instruments) aligned with the target values 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	-4,41	3Y Sharpe Ratio	-0,17
3Y Beta	1,19	3Y Std Dev	10,97
3Y R-Squared	85,97	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,99	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,34	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	2,82	4,51	4,13	2025	-	-	-	-
6-Mesi	4,52	7,22	5,67	2025	4,61	0,05	2,47	-1,27
1-Anno	8,22	11,81	11,11	2024	4,91	0,88	-3,48	7,76
3-Anni Ann.ti	0,09	4,72	3,45	2023	-6,43	-8,96	-7,18	4,11
5-Anni Ann.ti	0,90	4,80	3,75	2022	0,79	2,05	-0,60	1,33
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021				

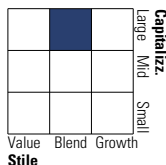
Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

## Portafoglio 30/11/2024

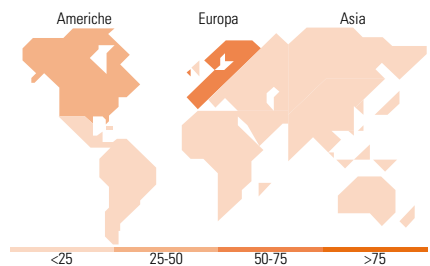


## Morningstar Style Box®

### Stile Azionario



### Redditto Fisso



## Titoli principali

Nome	Settore	%
MSCI Emerging Markets Index...	-	7,16
Apple Inc		2,67
Opz Spx 12/20/24 C6000	-	2,54
Italy (Republic Of)	-	2,47
Spain (Kingdom of)	-	2,22
ASML Holding NV		2,15
SAP SE		2,05
Spain (Kingdom of)	-	1,97
Microsoft Corp		1,90
Spain (Kingdom of)	-	1,88
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		27,02
Numero Complessivo di Titoli Azionari		187
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		32

## Distribuzione Settoriale %

	Fondo
Ciclico	36,66
Sensibile	46,58
Difensivo	16,76

## Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	69,75
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	30,25
Derivati	0,00

## Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>38,81</b>
Stati Uniti	37,15
Canada	0,96
America Latina e Centrale	0,70
<b>Europa</b>	<b>53,20</b>
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	51,69
Europa Occidentale - Non Euro	0,34
Europa dell'Est	0,19
Africa	0,30
Medio Oriente	0,68
<b>Asia</b>	<b>8,00</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	2,88
Asia - Emergente	5,11

## Anagrafica

Società di Gestione	Eurizon Capital S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	1,14 EUR	Investimento Min. Ingresso	500 EUR
Telefono	352494930303	(03/02/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.eurizoncapital.lu	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	23/11/2018	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	Inc		
NAV (03/02/2025)	EUR 110,32	ISIN	LU0923087075		
Patrimonio Netto (Mln)	27,82 EUR				

(30/11/2024)