

# Epsilon US Equity Value ESG Index

## Categoria Morningstar™

Azionari USA Large Cap Value

## Benchmark Morningstar

Morningstar US Large-Mid Cap Broad  
Value NR USD  
Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

MSCI USA Value ESG Screened NR EUR

## Morningstar Rating™

Senza rating

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

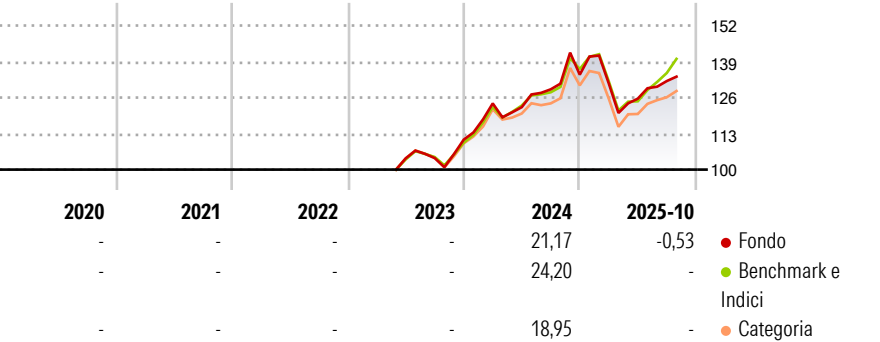
Il Fondo, di tipo indicizzato, è gestito passivamente e mira a replicare la performance dell'indice di riferimento "MSCI USA Value ESG Screened Index Net Eur" al lordo di commissioni e spese. L'indice è correlato al MSCI USA Value Index (Parent Index), concepito per riflettere la performance delle azioni di società a grande e media capitalizzazione degli Stati Uniti, che presentano caratteristiche "Value" sulla base di 3 indicatori: rapporto tra valore di libro della società e capitalizzazione di mercato, utili attesi su 12 mesi, rapporto tra il dividendo unitario e il prezzo di mercato dell'azione.

### Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD (dove applicabile)

### Rendimenti

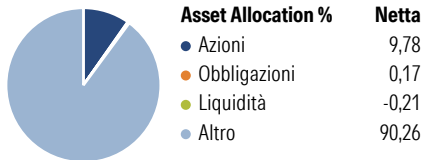


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,58	8,94	8,17
6-Mesi	8,79	15,53	12,29
1-Anno	1,99	5,44	1,60
3-Anni Ann.ti	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

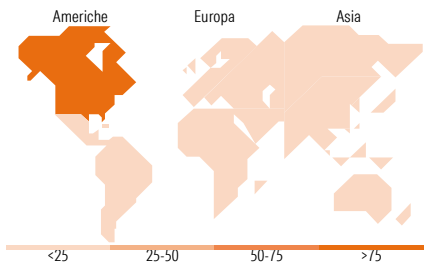
Rendimenti aggiornati al 04/11/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-2,37	-4,18	5,07	-
2024	11,81	-1,10	5,27	4,10
2023	-	-	0,08	6,41
2022	-	-	-	-

### Portafoglio 31/10/2025



Style Box Azionaria			Mkt Cap %	Fondo
			Giant	46,26
			Large	34,78
			Medium	17,85
			Small	1,12
Value	Blend	Growth	Micro	0,00
Style			Capitalizzazione media di mercato	Fondo
			Ave Mkt Cap EUR	412.038,41



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Receive EUR - 1D Euro Short...	—	52,14
Receive EUR - 1D Euro Short...	—	38,12
Italy (Republic Of)	—	16,36
France (Republic Of)	—	15,26
Italy (Republic Of)	—	14,97
Belgium (Kingdom Of)	—	12,32
France (Republic Of)	—	11,98
France (Republic Of)	—	10,49
Micro E-mini S&P 500 Index...	—	9,78
United States Treasury Notes	—	8,54
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		189,96
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		1

### Distribuzione Settoriale %

	Fondo
<b>Ciclico</b>	<b>26,56</b>
Materie Prime	1,47
Beni di Consumo Ciclici	10,66
Finanza	12,58
Immobiliare	1,84
<b>Sensibile</b>	<b>57,46</b>
Telecomunicazioni	10,38
Energia	2,79
Beni Industriali	7,40
Tecnologia	36,88
<b>Difensivo</b>	<b>15,98</b>
Beni Difensivi	4,68
Salute	8,96
Servizi di Pubblica Utilità	2,34

### Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>99,61</b>
Stati Uniti	99,61
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
<b>Europa</b>	<b>0,39</b>
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	0,12
Europa Occidentale - Non Euro	0,24
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

### Anagrafica

Società di Gestione	Eurizon Capital SGR SpA	Patrimonio Classe (Mln)	0,01 EUR	Investimento Min. Ingresso	500 EUR
Telefono	+39 2 88101	(27/11/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.eurizoncapital.it	Domicilio	ITALIA	T.E.R.	-
Data di Partenza	24/05/2023	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,21%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	24/05/2023	Inc/Acc	Acc		
NAV (04/11/2025)	EUR 6,71	ISIN	IT0005543019		

# Epsilon US Equity Value ESG Index

Patrimonio Netto (Mln)	60,05 EUR
(31/10/2025)	