# **Epsilon US Equity Value ESG Index**

# Categoria Morningstar™

Azionari USA Large Cap Value

#### **Benchmark Morningstar**

Usato nel Report

Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD

#### **Benchmark Dichiarato**

MSCI USA Value ESG Screened NR EUR

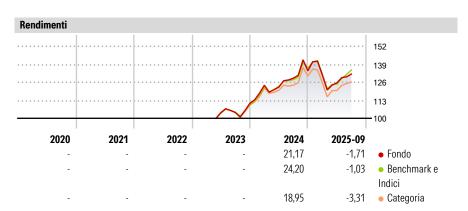
# Morningstar Rating™

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-I	Mid Ca	Broad Value NR USD (dove applicabile)



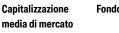
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1
3-Mesi	3,73	6,23	2,70	Trimestrali %	
6-Mesi	13,38	15,43	12,08	2025	-2,37
1-Anno	-2,28	1,43	-3,77	2024	11,81
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2023	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 16/10/2025	-	-	-	2021	-

#### Portafoglio 30/09/2025

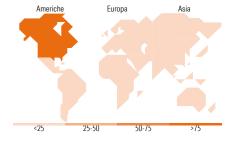




Mkt Cap %	Fondo
Giant	46,83
Large	34,43
Medium	17,71
Small	1,03
Micro	0,00
Canitalizzazione	Fondo



Ave Mkt Cap EUR 373.944,



Q2

-4,18

-1,10

Q3

5,07

5,27

0,08

Q4

4,10

6,41

Titoli principali		
Nome Se	ettore	%
Receive EUR - 1D Euro Short	_	38,09
Italy (Republic Of)	_	16,45
France (Republic Of)	_	15,33
Italy (Republic Of)	_	15,04
Belgium (Kingdom Of)	-	12,38
France (Republic Of)	_	12,03
France (Republic Of)	_	10,54
Micro E-mini S&P 500 Index	_	9,92
United States Treasury Notes	_	8,42
Belgium (Kingdom Of)	_	5,17
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		143,36
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazion	ari	5

Distribuzione Settoriale %	Fondo
<b>%</b> Ciclico	27,39
🚣 Materie Prime	1,58
🚗 Beni di Consumo Ciclici	10,67
🚅 Finanza	13,20
<u></u> Immobiliare	1,94
₩ Sensibile	56,50
☐ Telecomunicazioni	10,48
<b></b> Energia	2,89
🜣 Beni Industriali	7,52
Tecnologia	35,62
→ Difensivo	16,12
📜 Beni Difensivi	4,91
😷 Salute	8,86
Servizi di Pubblica Utilità	2,35

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	99,57
Stati Uniti	99,57
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	0,43
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	0,14
Europa Occidentale - Non Euro	0,25
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	0,00
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica	ı

Società di Gestione	Eurizon Capital SGR SpA
Telefono	+39 2 88101
Web	www.eurizoncapital.it
Data di Partenza	24/05/2023
Nome del Gestore	=
Data Inizio Gestione	24/05/2023
NAV (16/10/2025)	FUR 6.65

Patrimonio Classe (MIn)	59,84 EUR
Domicilio	ITALIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	IT0005543019

Investimento Min. Ingresso	500 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,21%
Commissione di incentivo	-

# **Epsilon US Equity Value ESG Index**

Patrimonio Netto (MIn)

59,66 EUR

(30/09/2025)

