

# 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

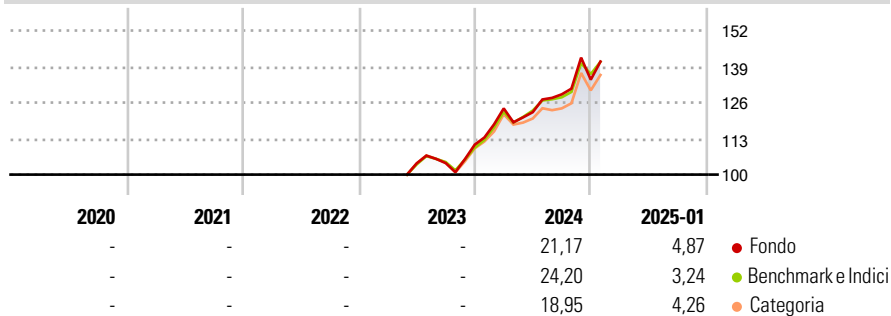
Il Fondo, di tipo indicizzato, è gestito passivamente e mira a replicare la performance dell'indice di riferimento "MSCI USA Value ESG Screened Index Net Eur" al lordo di commissioni e spese. L'indice è correlato al MSCI USA Value Index (Parent Index), concepito per riflettere la performance delle azioni 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)

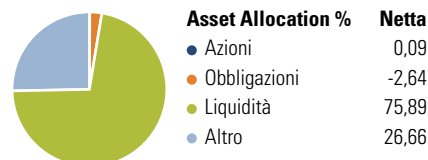
### Rendimenti



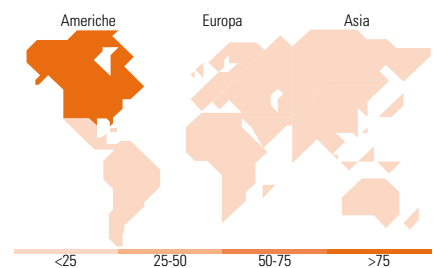
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	7,84	9,09	7,34	2025	-	-	-	-
6-Mesi	15,61	14,71	12,57	2024	11,81	-1,10	5,27	4,10
1-Anno	22,69	22,87	19,71	2023	-	-	0,08	6,41
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

### Portafoglio 31/12/2024



Style Box	Mkt Cap %	Fondo
Azionaria	Giant	46,91
	Large	34,56
	Medium	17,96
	Small	0,57
	Micro	0,00
Capitalizzazione media di mercato	Ave Mkt Cap EUR	349.750,03



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Receive EUR - 1D Euro Short...	-	26,66
European Union	-	13,03
France (Republic Of)	-	11,19
France (Republic Of)	-	10,95
France (Republic Of)	-	10,42
France (Republic Of)	-	9,62
France (Republic Of)	-	9,24
France (Republic Of)	-	5,23
Austria (Republic of)	-	5,17
Belgium (Kingdom Of)	-	5,16
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		106,68
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		4

### Distribuzione Settoriale %

	Fondo
<b>Ciclico</b>	<b>28,34</b>
Materie Prime	1,67
Beni di Consumo Ciclici	11,41
Finanza	13,16
Immobiliare	2,10
<b>Sensibile</b>	<b>53,53</b>
Telecomunicazioni	9,37
Energia	3,16
Beni Industriali	7,27
Tecnologia	33,73
<b>Difensivo</b>	<b>18,13</b>
Beni Difensivi	5,52
Salute	10,10
Servizi di Pubblica Utilità	2,51

### Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>99,45</b>
Stati Uniti	99,45
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
<b>Europa</b>	<b>0,52</b>
Regno Unito	0,09
Europa Occidentale - Euro	0,16
Europa Occidentale - Non Euro	0,27
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
<b>Asia</b>	<b>0,03</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,03
Asia - Emergente	0,00

### Anagrafica

Società di Gestione	Epsilon SGR SpA	Patrimonio Classe (Mln)	195,84 EUR	Investimento Min. Ingresso	500 EUR
Telefono	+39 02 8810 2070	(31/01/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.epsilonmgr.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 (03/02/2025)	EUR 7,14	ISIN	IT0005543019		

# Epsilon US Equity Value ESG Index

Patrimonio Netto (Mln) 191,03 EUR

(31/12/2024)