

# Epsilon European Equity ESG Index

## Categoria Morningstar™

Azionari Europa Large Cap Blend

## Benchmark Morningstar

Morningstar Developed Europe Target  
Market Exposure NR EUR  
Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

MSCI Europe ESG Leaders NR EUR

## Morningstar Rating™

Senza rating

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

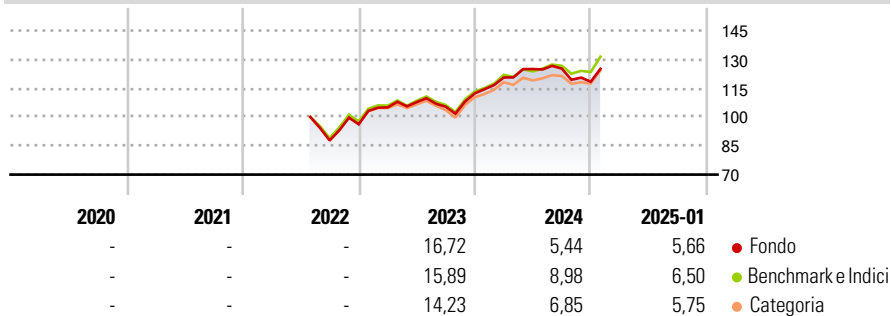
Il Fondo, di tipo indicizzato, è gestito passivamente e mira a replicare la performance dell'indice di riferimento "MSCI Europe ESG Leaders Net Eur" al lordo di commissioni e spese. L'indice è correlato al MSCI Europe Index (Parent Index), concepito per riflettere la performance delle azioni di società a grande e media capitalizzazione europee. L'indice esclude le società appartenenti al Parent Index che siano coinvolte a qualsivoglia titolo in attività controverse tra cui, a puro titolo esemplificativo, tabacco, armi convenzionali, armi nucleari, armi da fuoco civili e/o che derivino anche solo parte dei ricavi da attività di estrazione di carbone termico e sabbie bituminose e/o non rispettino i principi del Global Compact delle Nazioni...

### 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 Developed Europe Target Market Exposure NR EUR (dove applicabile)

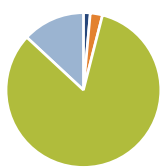
### Rendimenti



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1   | Q2   | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|------|------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 3,91  | 5,80  | 4,72  | 2025                     | -    | -    | -     | -     |
| 6-Mesi           | 3,77  | 8,48  | 6,49  | 2024                     | 7,39 | 3,64 | 0,20  | -5,46 |
| 1-Anno           | 8,78  | 13,85 | 12,24 | 2023                     | 9,17 | 2,60 | -2,23 | 6,58  |
| 3-Anni Ann.ti    | -     | -     | -     | 2022                     | -    | -    | -     | 9,59  |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | -     | -     | 2021                     | -    | -    | -     | -     |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -     | -     |                          |      |      |       |       |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

### Portafoglio 31/12/2024



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni           | 1,50  |
| ● Obbligazioni     | -2,69 |
| ● Liquidità        | 87,41 |
| ● Altro            | 13,78 |

### Style Box

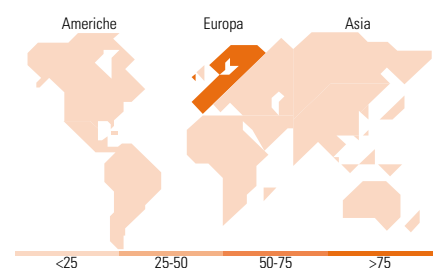
| Azionaria |       | Capitalizz. |
|-----------|-------|-------------|
| Value     | Blend |             |
| Large     | Mid   | Small       |
| Value     | Blend | Growth      |

### Mkt Cap %

| Mkt Cap % | Fondo |
|-----------|-------|
| Giant     | 49,82 |
| Large     | 37,96 |
| Medium    | 12,02 |
| Small     | 0,20  |
| Micro     | 0,00  |

### Capitalizzazione media di mercato

| Ave Mkt Cap EUR | Fondo |
|-----------------|-------|
| 59,452,6        | 1     |



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Receive 3M EURIBOR Pay...                   | -       | 13,77 |
| France (Republic Of)                        | -       | 13,24 |
| France (Republic Of)                        | -       | 8,99  |
| Italy (Republic Of)                         | -       | 8,01  |
| France (Republic Of)                        | -       | 7,71  |
| France (Republic Of)                        | -       | 7,62  |
| France (Republic Of)                        | -       | 7,61  |
| European Union                              | -       | 7,12  |
| European Stability Mechanism                | -       | 6,78  |
| France (Republic Of)                        | -       | 6,25  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 87,10 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 6     |

### Distribuzione Settoriale %

| Distribuzione Settoriale %  | Fondo        |
|-----------------------------|--------------|
| <b>Ciclico</b>              | <b>35,39</b> |
| Materie Prime               | 5,95         |
| Beni di Consumo Ciclici     | 8,91         |
| Finanza                     | 19,48        |
| Immobiliare                 | 1,05         |
| <b>Sensibile</b>            | <b>35,21</b> |
| Telecomunicazioni           | 4,38         |
| Energia                     | 4,79         |
| Beni Industriali            | 17,63        |
| Tecnologia                  | 8,42         |
| <b>Difensivo</b>            | <b>29,40</b> |
| Beni Difensivi              | 10,20        |
| Salute                      | 15,39        |
| Servizi di Pubblica Utilità | 3,80         |

### Ripartizione Geografica %

| Ripartizione Geografica %     | Fondo        |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>1,51</b>  |
| Stati Uniti                   | 1,51         |
| Canada                        | 0,00         |
| America Latina e Centrale     | 0,00         |
| <b>Europa</b>                 | <b>98,49</b> |
| Regno Unito                   | 22,26        |
| Europa Occidentale - Euro     | 50,19        |
| Europa Occidentale - Non Euro | 26,00        |
| Europa dell'Est               | 0,04         |
| 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  | Epsilon SGR SpA           | Patrimonio Classe (Mln) | 116,99 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     | 26/07/2022                | Valuta del Fondo        | EUR        | Spese correnti               | 0,18%   |
| Nome del Gestore     | -                         | UCITS                   | Si         | Commissione di incentivo     | -       |
| Data Inizio Gestione | 15/12/2022                | Inc/Acc                 | Acc        |                              |         |

# Epsilon European Equity ESG Index

NAV (03/02/2025)

EUR 6,35

ISIN

IT0005497448

Patrimonio Netto (Mln)

117,88 EUR

(31/12/2024)