

Epsilon US Equity Value ESG Index

Categoria Morningstar™

Azione 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

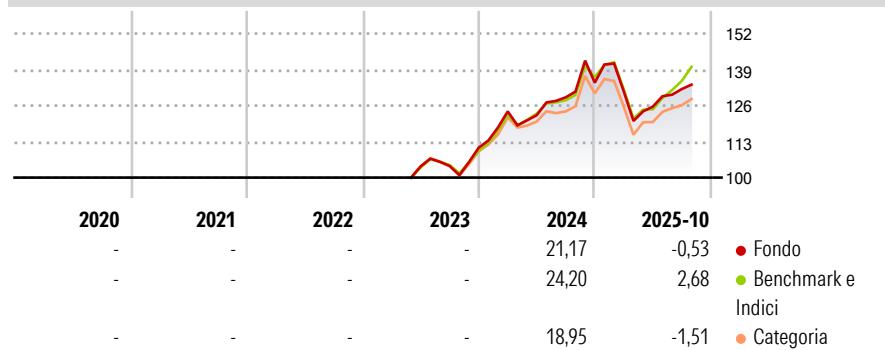
Morningstar Rating™

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.

Rendimenti



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	-

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

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,58	8,47	4,84
6-Mesi	8,79	16,15	9,78
1-Anno	1,99	3,47	-3,85
3-Anni Ann.ti	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 04/11/2025

Rendimenti Trimestrali %

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-2,37	-4,18	5,07	-
2024	11,81	-1,10	5,27	4,10
2023	-	-	0,08	6,41
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

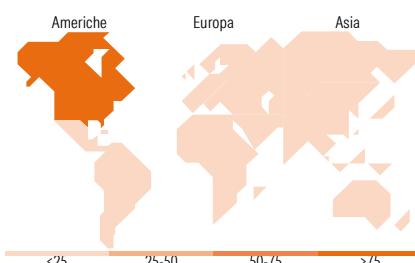
Portafoglio 31/10/2025



Asset Allocation %	Netta
• Azioni	9,78
• Obbligazioni	0,17
• Liquidità	-0,21
• Altro	90,26

Style Box Azionaria	Capitalizz.	Mkt Cap %	Fondo
Value	Large	Giant	46,26
Blend	Mid	Large	34,78
Growth	Small	Medium	17,85
		Small	1,12
		Micro	0,00

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 %

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

Ripartizione Geografica %

Fondo	
America	99,61
Stati Uniti	99,61
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	0,39
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
Asia	0,00
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergenti	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	Eurizon Capital SGR SpA	Patrimonio Classe (Mln)	59,91 EUR	Investimento Min. Ingresso	500 EUR
Telefono	+39 2 88101	(04/11/2025)		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)