

Informazioni chiave per gli investitori (KIID Key investor information document). Il presente documento contiene le informazioni chiave di cui tutti gli investitori devono disporre in relazione a questo Fondo. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni, richieste dalla normativa, hanno lo scopo di aiutare gli investitori a capire la natura di questo Fondo e i rischi ad esso connessi. Si raccomanda di prenderne visione in modo da operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire.



**Fondo “Eurizon AM TR Megatrend II”
(Codice ISIN portatore: IT0005426553)**

Questo Fondo è gestito da Eurizon Capital SGR S.p.A. appartenente al Gruppo Bancario Intesa Sanpaolo.

Il presente fondo, rientrando nell'ambito dell'applicazione della Direttiva 2009/65/CE, è autorizzato in Italia e regolamentato dalla Banca d'Italia e dalla Consob.

Eurizon Capital SGR è autorizzata in Italia e regolamentata dalla Banca d'Italia e dalla Consob.

Le informazioni chiave per gli investitori qui riportate sono valide al **21 febbraio 2022**

OBIETTIVI E POLITICA DI INVESTIMENTO

Caratteristiche essenziali del Fondo

Obiettivi e politica di investimento: il Fondo, di tipo Flessibile, mira a realizzare, in un Orizzonte Temporale di Investimento di 9 anni una crescita del capitale nel lungo termine. La SGR adotterà una strategia di gestione volta a perseguire un rendimento assoluto superiore a un parametro “*risk free+spread*” (Euribor 3 mesi + 2.0%), attraverso l'investimento principale in imprese italiane (anche piccole e medie imprese). **Non viene fornita alcuna garanzia agli investitori in merito al conseguimento dell'obiettivo del Fondo.**

Principali categorie di strumenti finanziari.

Il fondo investe in via principale in strumenti finanziari di natura obbligazionaria e monetaria e fino al 50% in azioni e altri strumenti finanziari rappresentativi del capitale di rischio di emittenti con ogni grado di capitalizzazione (bassa, media e alta). Il fondo può, inoltre, investire in misura contenuta in parti di OICR, anche collegati.

Gli investimenti sono effettuati senza restrizioni per area geografica e/o settore industriale. Gli investimenti sono denominati in qualsiasi valuta (incluse le valute dei Paesi Emergenti). L'investimento in Paesi Emergenti è effettuato in misura significativa.

La durata media tendenziale (*duration*) del portafoglio è non superiore a 7 anni. Il fondo investe fino ad un massimo del 30% in titoli con merito creditizio “*sub investment grade*”.

Lo stile di gestione del Fondo è dinamico volto a perseguire un rendimento assoluto. Nel processo decisionale rivestono particolare rilevanza l'analisi delle condizioni economiche di medio e lungo periodo, con particolare riguardo alla dinamica di crescita ed inflazione delle politiche monetarie e fiscali nonché l'analisi della curva dei rendimenti.

Per la componente azionaria si fa riferimento a tre tipologie di società: (i) società ad alta capitalizzazione area euro focalizzate su megatrend di lungo periodo (ad esempio disruptive technology, payment, climate change, luxury), (ii) società focalizzate su megatrend legati ai Mercati Emergenti (ad esempio andamento demografico e cambiamenti sociali, tecnologia) e (iii) società italiane del «Made in Italy» di media e bassa capitalizzazione con business internazionale.

Nell'ambito delle scelte di portafoglio, verranno considerati, in aggiunta ai criteri di investimento tradizionali, anche i criteri ambientali, sociali e di governance (cd. “Environmental, Social and Corporate governance factors” - fattori ESG) degli emittenti selezionati.

Il Fondo promuove caratteristiche ambientali, sociali e di governo societario (fattori ESG) ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento (UE)

2019/2088 del Parlamento Europeo e del Consiglio del 27 novembre 2019.

Per ulteriori informazioni si rinvia alla Sez. B) della Parte I del Prospetto.

Il Fondo utilizza strumenti finanziari derivati sia per finalità di copertura dei rischi sia per finalità diverse da quelle di copertura (tra cui arbitraggio). La leva finanziaria tendenziale, realizzata mediante esposizione di tipo tattico (e calcolata con il metodo degli impegni) è pari a 1,3. Tale utilizzo, sebbene possa comportare una temporanea amplificazione dei guadagni o delle perdite rispetto ai mercati di riferimento, non è comunque finalizzato a produrre un incremento strutturale dell'esposizione del fondo ai mercati di riferimento (effetto leva) e non comporta l'esposizione a rischi ulteriori che possano alterare il profilo di rischio-rendimento del fondo.

Parametro di riferimento (c.d. Benchmark)

In relazione allo stile di gestione adottato (stile flessibile), non è possibile individuare un benchmark rappresentativo della politica di gestione, quindi è stato indicato, in alternativa, un indicatore di rischio (VAR) pari a -6,50% (massima perdita attesa con il 99% di probabilità su un orizzonte temporale di un mese).

Il fondo è gestito attivamente senza riferimento ad un benchmark.

Investimenti al termine del periodo di investimento (9 anni): il fondo al termine del periodo di investimento (28 marzo 2030) investirà in via esclusiva in strumenti finanziari di natura monetaria e/o obbligazionaria tra cui fondi/SICAV (inclusi ETF) anche collegati, emessi in Euro, depositi bancari o liquidità. La *duration* del portafoglio non sarà superiore a 12 mesi.

Rimborso delle quote. È possibile richiedere il rimborso delle quote in qualsiasi momento, senza alcun preavviso. Il valore del rimborso è determinato in base al valore unitario delle quote – calcolato con cadenza giornaliera – del giorno di ricezione della domanda da parte della SGR.

Proventi: il Fondo è a distribuzione dei proventi.

Limitatamente alla prima cedola l'importo da distribuire potrà anche essere superiore al risultato di gestione del Fondo (variazione del valore della quota); in tal caso la distribuzione rappresenterà un rimborso parziale del valore delle quote anche se non porterà comunque un rimborso automatico di un numero determinato di quote o frazioni di esse bensì una diminuzione del loro valore unitario.

Periodo minimo raccomandato: 5 anni

Raccomandazione: questo Fondo potrebbe non essere indicato per gli investitori che prevedono di ritirare il proprio capitale entro 5 anni.

PROFILO DI RISCHIO E DI RENDIMENTO



I dati storici utilizzati per calcolare l'indicatore sintetico potrebbero non costituire un'indicazione affidabile circa il futuro profilo di rischio del Fondo.

La categoria di rischio/rendimento indicata potrebbe non rimanere invariata e la classificazione del Fondo potrebbe cambiare nel tempo. L'appartenenza alla categoria più bassa non garantisce un investimento esente da rischi.

Il Fondo è stato classificato nella categoria 4 in quanto il limite interno di volatilità previsto per il Fondo è compreso tra 5% e 10%.

Altri rischi che rivestono importanza significativa per il Fondo e che non sono adeguatamente rilevati dall'indicatore sintetico sono:

Rischio di credito: rischio che il soggetto emittente le obbligazioni non paghi al Fondo, anche solo in parte, gli interessi e il capitale o che le probabilità di tale pagamento si riducano.

Rischio di liquidità: rischio che alcuni strumenti finanziari in cui il Fondo è investito non possano essere prontamente venduti, a meno di una sensibile riduzione di prezzo, o che il basso livello di liquidità possa incidere sul livello di liquidità del Fondo nel suo insieme.

La presenza dei rischi connessi alla partecipazione al Fondo può determinare la possibilità di non ottenere, al momento del rimborso, la restituzione dell'investimento finanziario.

SPESE

Le spese da Lei sostenute sono utilizzate per coprire i costi di gestione del Fondo, compresi i costi legati alla commercializzazione e alla distribuzione dello stesso. Tali spese riducono la crescita potenziale del Suo investimento

| Spese una tantum prelevate prima o dopo l'investimento | |
|--|---|
| Spese di sottoscrizione | Non previste |
| Spese di rimborso | Sulle somme disinvestite nei primi 5 anni dal termine del Periodo di Sottoscrizione è applicata l'aliquota massima del 2,60%. Tale aliquota decresce col trascorrere del tempo. La formula usata per determinare la commissione applicata è riportata nel Prospetto, Parte C), par. 15.2.2. Dal 29/03/2026 le commissioni di rimborso non sono previste. |
| Percentuale massima che può essere prelevata dal Suo capitale prima che venga investito o disinvestito | |
| Spese prelevate dal fondo in un anno | |
| Spese correnti | 1,64% (*) |
| Spese prelevate dal fondo a determinate condizioni specifiche | |
| Commissioni legate al rendimento | 25% della differenza tra la variazione percentuale del valore della quota del fondo al lordo della commissione di incentivo e la variazione percentuale nel medesimo periodo del seguente obiettivo di rendimento: 100% Euribor |

3 mesi + 2.0%. Nel corso dell'ultimo esercizio la commissione legata al rendimento è stata pari a 0% (*).

È prevista l'applicazione di **diritti fissi**, il cui ammontare è indicato nel prospetto.

Può informarsi circa l'importo effettivo delle spese di rimborso e dei diritti fissi presso il Suo consulente finanziario o distributore.

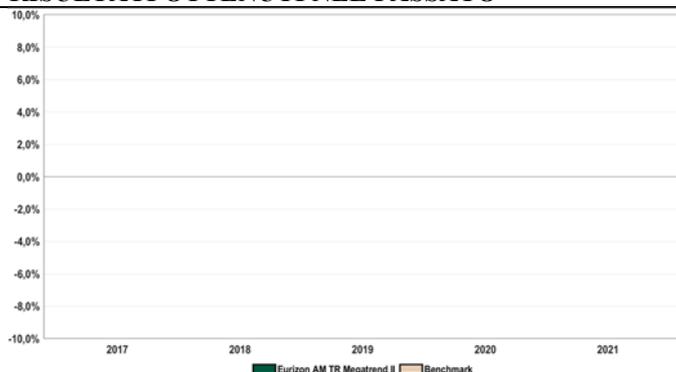
Il dato relativo alle spese correnti (che include le spese di collocamento, pari al 2,60%, imputate al fondo in un'unica soluzione al termine del periodo di sottoscrizione e ammortizzate linearmente nei primi cinque anni successivi mediante addebito sul NAV) è stimato sulla base del totale delle spese annuali attese; il valore delle spese correnti può variare da un anno all'altro.

L'importo di tali spese non comprende i costi di transazione del portafoglio.

(*) Calcolate sul patrimonio medio del fondo dell'anno precedente.

Per maggiori informazioni circa le spese, si rinvia alla Sezione C) del Prospetto (Parte I).

RISULTATI OTTENUTI NEL PASSATO



I dati disponibili non sono sufficienti a fornire agli investitori un'indicazione utile per i risultati ottenuti nel passato poiché il Fondo non dispone di risultati per un anno civile completo.

I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri.

Le performance storiche sono calcolate in Euro.

I dati delle performance storiche del Fondo includono le spese a carico del Fondo ma non le spese direttamente a carico dell'investitore.

Il fondo è gestito attivamente senza riferimento ad un benchmark.

Il Fondo è stato istituito il **29 ottobre 2020** ed è operativo dal **25/02/2021**.

INFORMAZIONI PRATICHE

Depositario

State Street Bank International GmbH - Succursale Italia, Via F. Aporti 10, Milano. **Ulteriori informazioni**

Periodo di Sottoscrizione: dal **25 febbraio 2021** al **26 marzo 2021**.

L'importo minimo della sottoscrizione, da effettuarsi mediante versamento in un'unica soluzione, è pari a Euro 1.000,00. Per ulteriori dettagli si rinvia al Prospetto del Fondo (Parte I, Sez. D) disponibile sul nostro sito internet www.eurizoncapital.com e presso i distributori. Ulteriori informazioni sul Fondo, il Prospetto, il Regolamento di gestione, l'ultima Relazione annuale e la Relazione semestrale successiva, redatti in lingua italiana, sono disponibili sul nostro sito internet www.eurizoncapital.com e presso i distributori. Potete richiedere tali documenti per iscritto ad EURIZON CAPITAL SGR S.p.A., Piazzetta Giordano Dell'Amore 3, 20121 Milano, anche tramite fax indirizzato al numero 02/8810.2081 ovvero tramite il sito Internet, Sezione "Contatti"; provvederemo ad inviarveli gratuitamente. I documenti contabili del Fondo sono disponibili gratuitamente anche presso la nostra sede e presso la sede del Depositario. Per informazioni e chiarimenti potete rivolgervi direttamente alla Società chiamando il numero 02/8810.8810.

Pubblicazione del valore della quota

Il valore della quota del Fondo è pubblicato giornalmente sul quotidiano "Il Sole 24 Ore" e sul nostro sito Internet www.eurizoncapital.com.

Legislazione fiscale

Il Fondo è soggetto alla legislazione fiscale italiana; tale legislazione può avere un impatto sulla vostra posizione fiscale.

Politiche e prassi di remunerazione e incentivazione del personale

Le informazioni aggiornate di dettaglio sulla politica e prassi di remunerazione e incentivazione del personale, inclusi i criteri e le modalità di calcolo delle remunerazioni e degli altri benefici e i soggetti responsabili per la determinazione delle remunerazioni e per l'assegnazione degli altri benefici, nonché la composizione del comitato remunerazioni, sono disponibili sul nostro sito Internet www.eurizoncapital.com. Una copia cartacea o un diverso supporto durevole contenente tali informazioni sono disponibili per gli investitori gratuitamente, su richiesta.

Dichiarazione di responsabilità

Eurizon Capital SGR S.p.A. può essere ritenuta responsabile esclusivamente sulla base delle dichiarazioni contenute nel presente documento che risultano fuorvianti, inesatte o incoerenti rispetto alle corrispondenti parti del Prospetto del Fondo.