

**PARTE II DEL PROSPETTO - ILLUSTRAZIONE DEI DATI PERIODICI
DI RISCHIO-RENDIMENTO E COSTI DEL FONDO**

Epsilon STEP 30 Megatrend ESG Settembre 2027

Data di deposito in Consob della Parte II: 22/02/2024

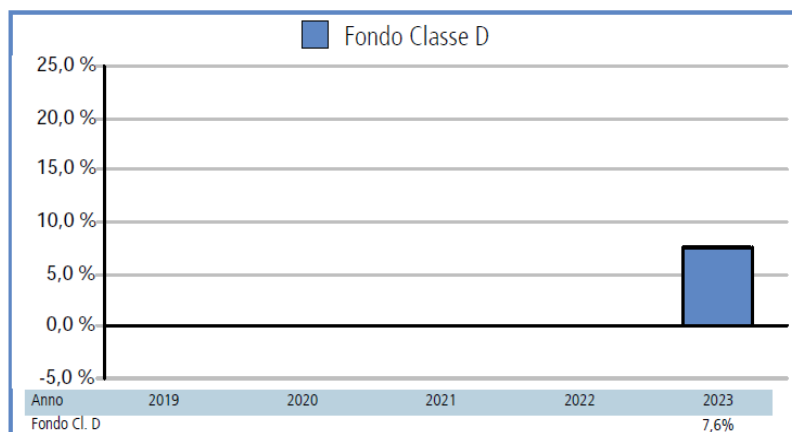
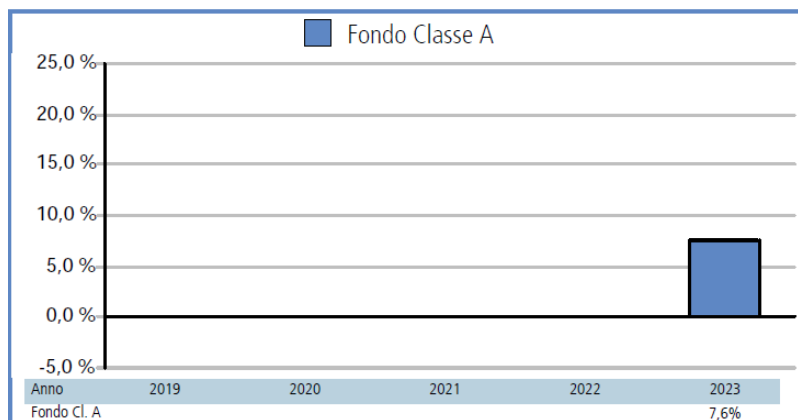
Data di validità della Parte II: dal 29/02/2024

1. DATI PERIODICI DI RISCHIO-RENDIMENTO DEL FONDO

EPSILON STEP 30 MEGATREND ESG SETTEMBRE 2027

FONDO FLESSIBILE

RENDIMENTO ANNUO DEL FONDO (*)



(*) Il Fondo è operativo dal 24/05/2022

In luogo del benchmark viene fornita una misura di rischio alternativa:

MISURA DI RISCHIO EX ANTE DEL FONDO

Value at Risk (VaR) calcolato su un orizzonte temporale di un mese ed un intervallo di confidenza del 99%: -6,50%.

MISURA DI RISCHIO EX POST DEL FONDO

Minor rendimento realizzato su base mensile nel corso del 2023 determinato escludendo l'1% dei peggiori risultati:

Classe A: -1,71%

Classe D: -1,69%

I dati di rendimento del Fondo non includono le spese a carico dell'investitore applicabili in caso di rimborso.

Dal 1° luglio 2011 la tassazione è a carico dell'investitore.

I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri

| | Classe A | Classe D |
|-------------------------------------|-------------------|------------------|
| Inizio collocamento | 24 maggio 2022 | 24 maggio 2022 |
| Valuta | Euro | Euro |
| Patrimonio netto al 29.12.23 | 40,08 mln di Euro | 8,75 mln di Euro |
| Valore quota al 29.12.23 | 5,108 Euro | 5,054 Euro |

QUOTA PARTE DEGLI ONERI PERCEPITA IN MEDIA DAI COLLOCATORI NEL 2023 (*)

| Oneri | Quota parte percepita in media dai collocatori | |
|--|---|-----------------|
| | Classe A | Classe D |
| Provvigione di gestione | 86,70% | 86,70% |
| Provvigione di incentivo (Commissione legata al rendimento) | 0% | 0% |
| Commissione di rimborso | 0% | 0% |
| Diritti fissi e altre spese | 0% | 0% |

(*) Tali percentuali sono al lordo del corrispettivo trattenuto da Eurizon Capital SGR quale remunerazione per l'attività svolta in qualità di Distributore Principale.

2. COSTI E SPESE SOSTENUTI DAL FONDO

| Fondo | Spese correnti anno 2023 | Commissioni legate al rendimento tra il 1° ottobre 2022 ed il 30 settembre 2023 |
|--|-------------------------------------|--|
| STEP 30 Megatrend ESG Settembre 2027 (Classe A) | 1,28% | 0 |
| STEP 30 Megatrend ESG Settembre 2027 (Classe D) | 1,29% | 0 |

Il valore delle spese correnti può variare da un anno all'altro ed esclude le commissioni legate al rendimento ed i costi di negoziazione che hanno gravato sul patrimonio del Fondo.

La quantificazione degli oneri fornita inoltre non tiene conto degli oneri gravanti direttamente sul sottoscrittore, da pagare al momento del rimborso (si rinvia alla Parte I, Sez. C), par. 17 nonché al Regolamento di gestione del Fondo).

Le spese correnti includono la commissione di collocamento, pari al 2,00%, applicata sull'importo risultante dal numero di quote in circolazione al termine del "Periodo di Sottoscrizione" per il valore unitario iniziale della quota del Fondo (pari a 5 euro). Tale commissione è imputata al Fondo e prelevata in un'unica soluzione al termine del "Periodo di Sottoscrizione" ed è ammortizzata linearmente entro i 3 anni successivi a tale data mediante addebito giornaliero sul valore complessivo netto del Fondo (si rinvia alla Parte I, Sez. C), par. 17 nonché al Regolamento di gestione del Fondo).

Le spese correnti includono inoltre gli oneri relativi agli OICR in cui il Fondo investe.

Le informazioni sui costi sostenuti dal Fondo nell'ultimo anno sono reperibili nella Nota Integrativa del rendiconto del Fondo.