

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

***Epsilon STEP 30 Megatrend ESG Dicembre 2027 – Edizione 2***  
***Epsilon Difesa 100 Azioni ESG Dicembre 2027***

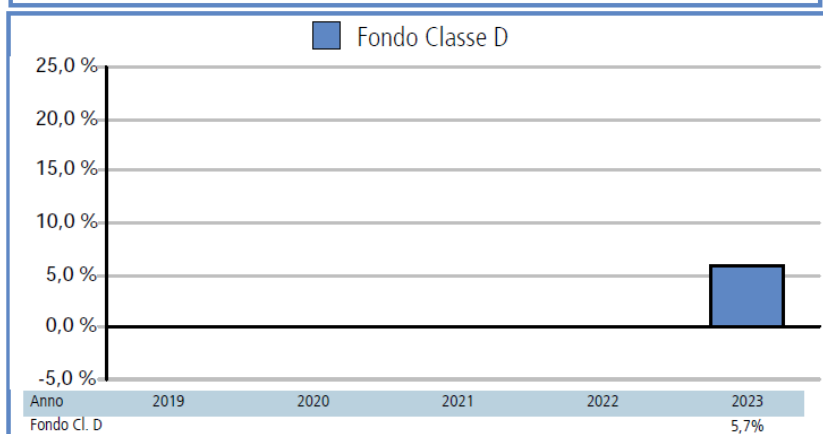
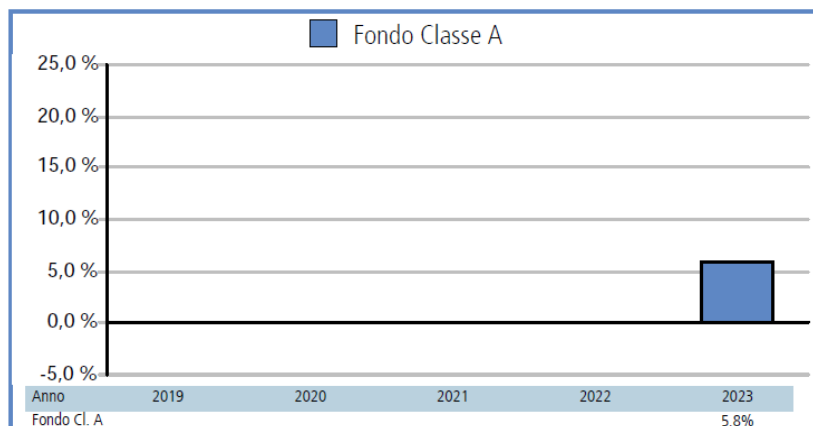
Data di deposito in Consob della Parte II: 22/02/2024

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

**1. DATI PERIODICI DI RISCHIO-RENDIMENTO DEI FONDI**

**EPSILON STEP 30 MEGATREND ESG DICEMBRE 2027 – EDIZIONE 2**  
**FONDO FLESSIBILE**

**RENDIMENTO ANNUO DEL FONDO (\*)**



(\*) Il Fondo è operativo dal 18/10/2022

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: -1,72%

Classe D: -1,70%.

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***

	<b>Classe A</b>	<b>Classe D</b>
<b>Inizio collocamento</b>	18 ottobre 2022	18 ottobre 2022
<b>Valuta</b>	Euro	Euro
<b>Patrimonio netto al 29.12.23</b>	8,54 mln di Euro	2,23 mln di Euro
<b>Valore quota al 29.12.23</b>	5,201 Euro	5,200 Euro

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

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

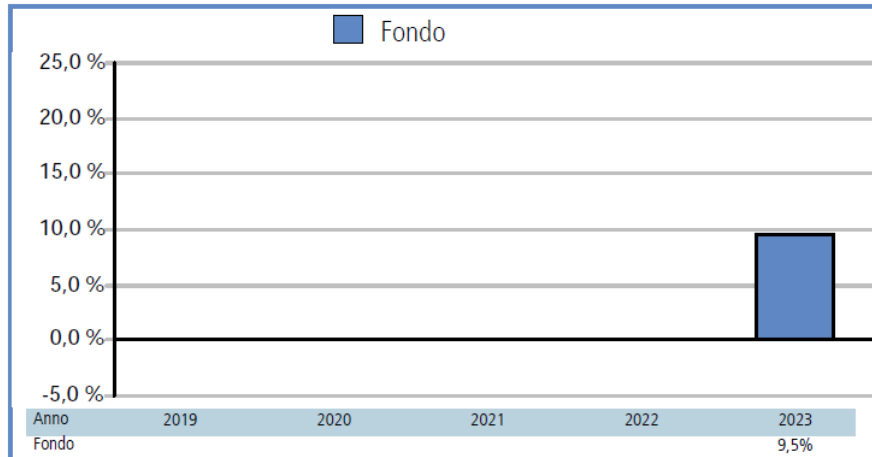
(\*) Tali percentuali sono al lordo del corrispettivo trattenuto da Eurizon Capital SGR quale remunerazione per l'attività svolta in qualità di Distributore Principale.

## **EPSILON DIFESA 100 AZIONI ESG DICEMBRE 2027**

**FONDO FLESSIBILE**

**FONDO A CAPITALE PROTETTO**

### **RENDIMENTO ANNUO DEL FONDO (\*)**



(\*) Il Fondo è operativo dal 18/10/2022

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

#### **MISURA DI RISCHIO EX ANTE DEL FONDO**

Volatilità annualizzata, coerente con la misura di rischio espressa dall'indicatore sintetico, pari a 5,42%.

La misura di volatilità annualizzata fornita alla data di avvio dell'operatività del Fondo, calcolata sui rendimenti storici di un portafoglio modello, era tendenzialmente pari a 10,5%.

#### **MISURA DI RISCHIO EX POST DEL FONDO**

Minor rendimento realizzato su base mensile nel corso del 2023 determinato escludendo l'1% dei peggiori risultati: -1,95%.

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***

<b>Inizio collocamento</b>	18 ottobre 2022
<b>Valuta</b>	Euro
<b>Patrimonio netto al 27.12.23</b>	139,08 mln di Euro
<b>Valore quota al 27.12.23</b>	5,280 Euro

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

Oneri	Quota parte percepita in media dai collocatori
<b>Provvigione di gestione</b>	80,40%
<b>Commissione di rimborso</b>	0%
<b>Diritti fissi e altre spese</b>	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 DAI FONDI**

Fondo	Spese correnti anno 2023	Commissioni legate al rendimento anno 2023
STEP 30 Megatrend ESG Dicembre 2027 – Edizione 2 (Classe A)	1,24%	0,23%
STEP 30 Megatrend ESG Dicembre 2027 – Edizione 2 (Classe D)	1,26%	0,23%
Difesa 100 Azioni ESG Dicembre 2027	1,05%	Non previste

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. 13 nonché al Regolamento di gestione dei Fondi).

Le spese correnti includono la commissione di collocamento, nella misura prevista per ciascun Fondo, 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 sul valore complessivo netto del Fondo in ogni giorno di valorizzazione (si rinvia alla Parte I, Sez. C), par. 13 nonché al Regolamento di gestione dei Fondi).

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

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