

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

Epsilon Difesa 100 Azioni – Edizione 3

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

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

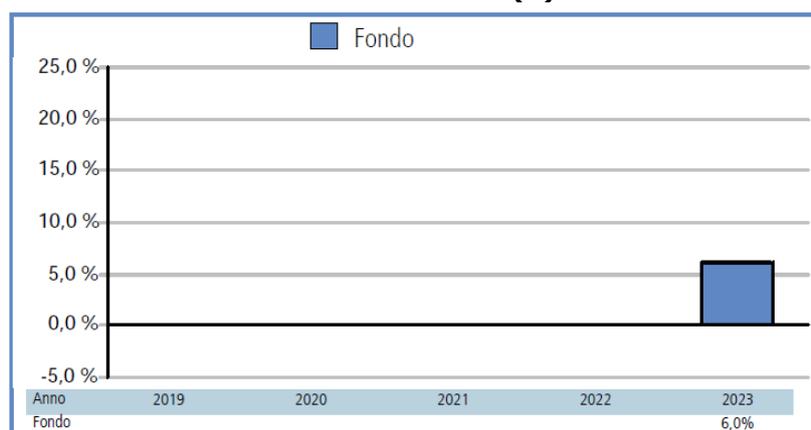
1. DATI PERIODICI DI RISCHIO-RENDIMENTO DEL FONDO

EPSILON DIFESA 100 AZIONI – EDIZIONE 3

FONDO FLESSIBILE

FONDO A CAPITALE PROTETTO

RENDIMENTO ANNUO DEL FONDO (*)



(*) Il Fondo è operativo dal 06/12/2022

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 4,92%.

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: -2,08%.

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

| | |
|-------------------------------------|--------------------|
| Inizio collocamento | 6 dicembre 2022 |
| Valuta | Euro |
| Patrimonio netto al 27.12.23 | 164,30 mln di Euro |
| Valore quota al 27.12.23 | 5,300 Euro |

2. COSTI E SPESE SOSTENUTI DAL FONDO NELL'ANNO 2023

| Costi correnti registrati nell'anno sul valore dell'investimento | |
|---|--------------|
| Commissioni di gestione e altri costi amministrativi o di esercizio | 1,01% |
| Costi di transazione | 0,10% |
| Oneri accessori sostenuti in determinate condizioni | |
| Commissioni di <i>performance</i> | Non previste |

Le commissioni di gestione e altri costi amministrativi o di esercizio includono la commissione di collocamento, pari al 2,00%, applicata sull'importo risultante dal numero di quote in circolazione all'8 febbraio 2023 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 nella medesima data 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. 16 nonché al Regolamento di gestione del Fondo).

Il valore delle commissioni di gestione e degli altri costi amministrativi o di esercizio non tiene conto degli oneri gravanti direttamente sul sottoscrittore, da pagare al momento del rimborso (si rinvia alla Parte I, Sez. C), par. 16 nonché al Regolamento di gestione del Fondo).

Le commissioni di gestione e gli altri costi amministrativi o di esercizio includono inoltre gli oneri relativi agli OICR in cui il Fondo investe.

L'importo dei costi di transazione riflette i costi sostenuti per le operazioni di acquisto e di vendita degli strumenti finanziari effettuate dal Fondo.

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

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

| Oneri | Quota parte percepita in media dai collocatori |
|------------------------------------|---|
| Provvigione di gestione | 80,19% |
| Commissione di collocamento | 91,25% |
| Commissione di rimborso | 0% |
| Diritti fissi e altre spese | 0% |

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