

|                                  |              |
|----------------------------------|--------------|
| Categoria Assogestioni           |              |
| Bilanciati                       |              |
| Inizio collocamento              | 11.10.2017   |
| Patrimonio (EUR)                 | 66 mil.      |
| Valore quota (EUR)               | 4,704        |
| Morningstar Rating <sup>TM</sup> | No Rating    |
| ISIN                             | IT0005278970 |

|   |  |
|---|--|
| Nome del gestore  | Sara Ghisalberti<br>Francesco Sedati   |
| Benchmark   | 80% ECPI Euro Ethical Corporate Bond (già ECPI - Ethical Euro Corporate Bond)<br>15% ECPI EMU Ethical Equity (già ECPI Ethical Euro)<br>5% ICE BofAML Euro Treasury Bill |
| Il Fondo non si propone di replicare la composizione del benchmark. |  |

Profilo di rischio e di rendimento

RISCHIO PIU' BASSO ← → RISCHIO PIU' ELEVATO

1

2

3

4

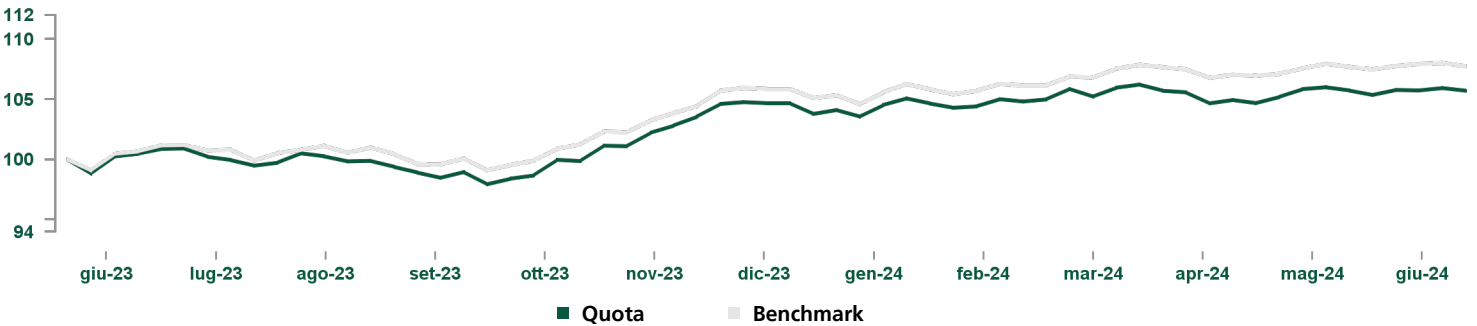
5

6

7

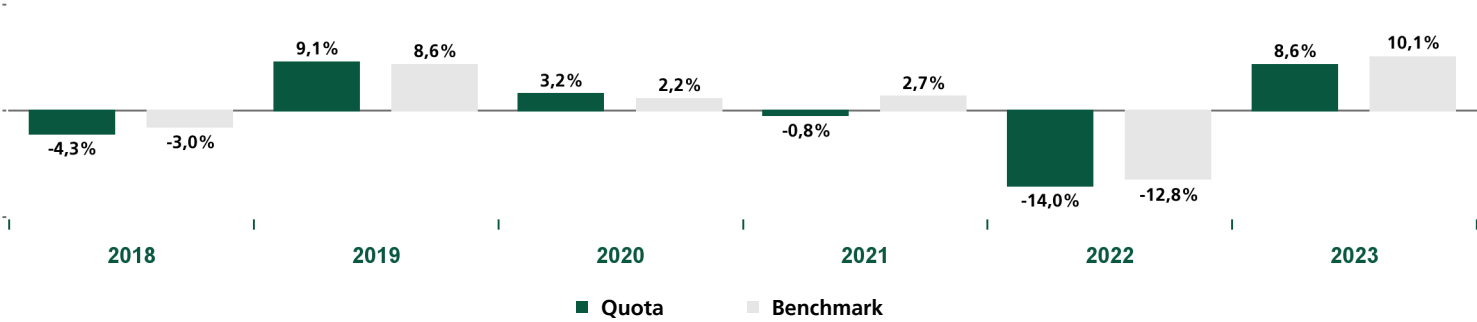
I dati storici utilizzati per calcolare l'indicatore sintetico potrebbero non costituire un'indicazione affidabile circa il futuro profilo di rischio del Fondo. La categoria di rischio/rendimento indicata potrebbe non rimanere invariata, e quindi la classificazione del Fondo potrebbe cambiare nel tempo. L'appartenenza alla categoria più bassa non garantisce un investimento esente da rischi. Il "Periodo di Sottoscrizione" del Fondo è concluso. L'investitore potrà richiedere gratuitamente alla SGR l'invio dell'ultima versione disponibile del KIID e del Prospetto - Parte I.

Andamento del valore della quota del fondo e del benchmark



| Rendimenti | 1 mese | 3 mesi | Da inizio anno | 1 anno | 3 anni |
|------------|--------|--------|----------------|--------|--------|
| Quota      | 0,3%   | -0,5%  | 1,0%           | 5,7%   | -5,8%  |
| Benchmark  | 0,2%   | 0,0%   | 1,8%           | 7,7%   | -1,7%  |

Rendimento annuo del fondo e del benchmark



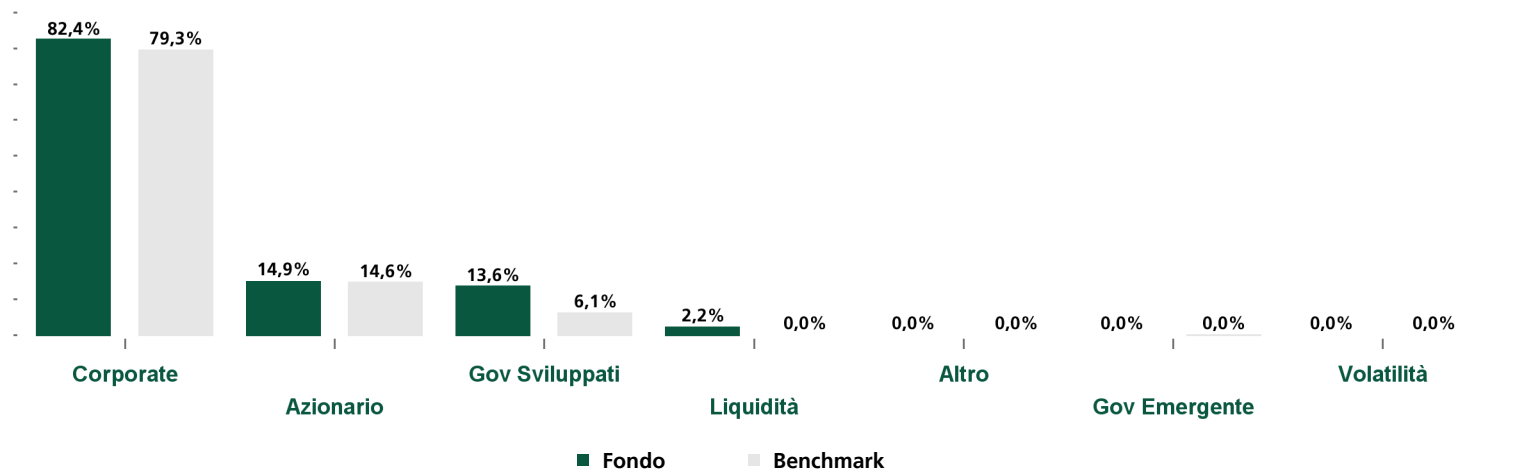
| Rendimento del fondo e del benchmark al 30.06.2024 | Quota | Benchmark | Misure statistiche <sup>1</sup> | 1 anno |
|--|-------|-----------|---------------------------------|--------|
| Rendimento ultimi 12 mesi                          | 5,7%  | 7,7%      | Volatilità                      | 4,67%  |
| Rendimento medio annuo composto ultimi 3 anni      | -2,0% | -0,6%     | Tracking Error Volatility       | 1,50%  |
| Rendimento medio annuo composto ultimi 5 anni      | -0,3% | 0,8%      | Sharpe Ratio                    | 0,49   |

Dati aggiornati all'ultimo trimestre solare concluso

Principali strumenti finanziari in portafoglio (escluso liquidità)

| Codice ISIN  | Strumento finanziario       | Peso  | Codice ISIN  | Strumento finanziario | Peso   |
|--------------|-----------------------------|-------|--------------|-----------------------|--------|
| -            | FUT EURO-BUND FUTURE Sep24  | 8,74% | NL0010273215 | ASML HOLDING NV       | 0,99%  |
| -            | FUT US 10YR NOTE (CBT)Sep24 | 5,58% | FR0000121972 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | 0,90%  |
| -            | FUT Euro-BTP Future Sep24   | 2,09% | XS1681520786 | TCLAU 1,75% 03/29/28  | 0,85%  |
| XS1069439740 | AXASA TV 12/49              | 1,07% | XS2317069685 | ISPIM 0 3/4 03/16/28  | 0,82%  |
| -            | FUT US LONG BOND(CBT) Sep24 | 1,00% | DE0007164600 | SAP SE                | 0,78%  |
|              |                             |       | Totale       |                       | 22,81% |

Composizione del portafoglio

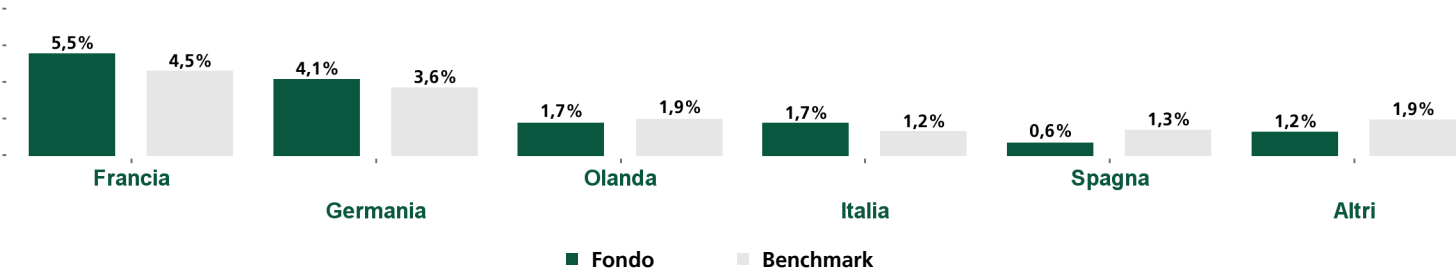


I dati considerano anche l'esposizione derivante dall'eventuale utilizzo degli strumenti finanziari derivati, inclusi quelli presenti negli eventuali fondi sottostanti. L'investimento in depositi bancari a scadenza è incluso nell'asset class "Corporate". L'asset class "Governativi Sviluppati" può includere strumenti finanziari derivati su tassi interbancari.

| Depositi  |  | Fondi e ETF di terzi |  | Peso                 |  | Duration |  |
|---|--|----------------------|--|----------------------|--|----------|--|
| Depositi  |  | -                    |  | Fondi e ETF di terzi |  | -        |  |
| Include depositi bancari a scadenza e certificati di deposito |  |                      |  | Fondo                |  | 3,96     |  |
|   |  |                      |  | Benchmark            |  | 3,60     |  |

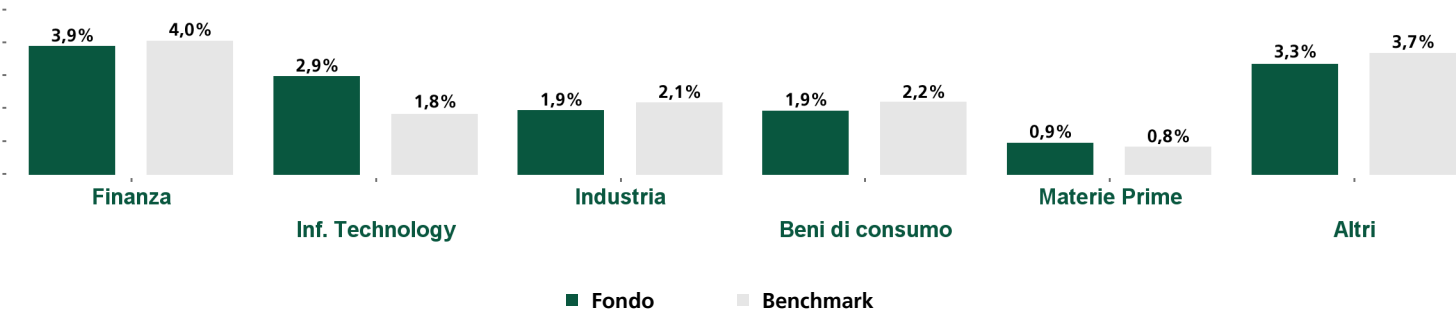
<sup>1</sup> Volatilità: la volatilità di un fondo comune di investimento indica la variabilità del rendimento del fondo nel tempo e rappresenta quindi la tendenza dei valori della quota a discostarsi dal valore medio (della quota) nel periodo considerato.  
Tracking Error Volatility: la misura descrive la volatilità dei rendimenti differenziali di un fondo rispetto ad un indice di riferimento.  
Sharpe Ratio: l'indice di Sharpe è un indicatore di performance corretta per il rischio. Esso individua il maggiore (o minore) rendimento registrato dal fondo rispetto all'investimento privo di rischio e lo rapporta al rischio sostenuto ed espresso dalla deviazione standard. Si assume come Indice Free Risk il Bloomberg Euro Treasury Bills Index.

Esposizione azionaria geografica sul portafoglio complessivo



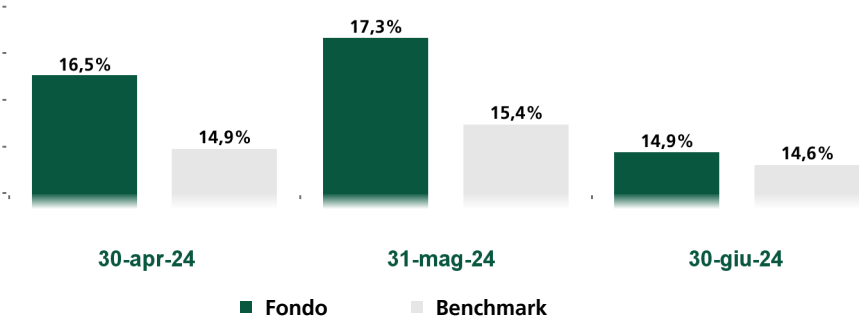
La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva azionaria, inclusi gli strumenti derivati (in particolare per gli Equity Asset Swap e per le Opzioni su azione è considerato il market value)

Esposizione azionaria settoriale sul portafoglio complessivo



La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva azionaria, inclusi gli strumenti derivati (in particolare per gli Equity Asset Swap e per le Opzioni su azione è considerato il market value)

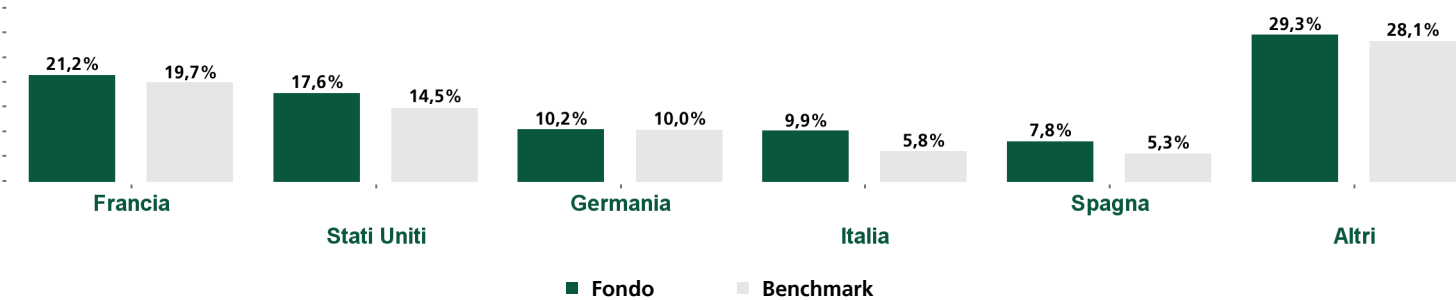
Esposizione azionaria sul portafoglio complessivo negli ultimi mesi



La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva obbligazionaria, inclusi gli strumenti derivati.

| Esposizione per Rating S&P | Peso   |
|----------------------------|--------|
| AAA                        | 4,35%  |
| AA                         | 7,83%  |
| A                          | 33,57% |
| BBB                        | 41,48% |
| BB                         | 4,00%  |
| B                          | 0,44%  |

Esposizione obbligazionaria per paese emittente



La somma dei pesi rappresenta l'esposizione complessiva obbligazionaria, inclusi gli strumenti derivati.

ALTRE INFORMAZIONI

|                                    |   |
|------------------------------------|---|
| Note anagrafiche                   | Il fondo si qualifica ai sensi dell'art. 8 del Regolamento (UE) 2019/2088; per maggiori dettagli si veda l'Informativa sulla Sostenibilità. |
| Orizzonte temporale d'investimento | Questo fondo potrebbe non essere indicato per gli investitori che prevedono di ritirare il proprio capitale entro 5 anni.                   |
| Periodo di sottoscrizione          | 11.10.2017 - 14.11.2017   |
| Periodo di investimento            | 15.11.2017 - 15.11.2026   |

Importi ultime distribuzioni dei proventi per singola quota

|                   | gen-19 | gen-20 | dic-20 | dic-21 |
|-------------------|--------|--------|--------|--------|
| Importi (in euro) | 0,050  | 0,050  | 0,150  | 0,063  |

ONERI

|                                  |  |
|----------------------------------|--|
| Sottoscrizione iniziale minima   | 1.000 euro   |
| Spese di sottoscrizione          | Non previste   |
| Spese di rimborso                | Max 2,50%  |
| Spese correnti annue             | 1,42% (di cui provvigione di gestione 1,30%)<br>Il valore delle spese correnti si basa sulle spese dell'anno precedente. Tale valore 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.  |
| Commissioni legate al rendimento | La commissione legata al rendimento è pari al 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 valore dell'indice di riferimento così composto: 80% ECPI Euro Ethical Corporate Bond, 15% ECPI EMU Ethical Equity, 5% ICE BofAML Euro Treasury Bill. Gli indici azionari di riferimento utilizzati per il calcolo delle commissioni di incentivo vengono calcolati ipotizzando il reinvestimento di dividendi (indici Total Return). |

DISCLAIMER

Fonte: Elaborazione dati Eurizon Capital SGR S.p.A.

Per un maggior dettaglio informativo in merito alla politica di investimento concretamente posta in essere dal Fondo si raccomanda la lettura dell'ultimo rendiconto annuale di gestione.

Morningstar Rating™

MORNINGSTAR è un fornitore indipendente di analisi degli investimenti. © 2024 Morningstar. Tutti i diritti riservati. Le informazioni contenute nel presente documento: (1) sono di proprietà di Morningstar e/o dei suoi fornitori di contenuti; (2) non possono essere copiate o diffuse; e (3) non vi è alcuna garanzia che siano accurate, complete o aggiornate. Né Morningstar né i suoi fornitori di contenuti sono responsabili di qualsiasi danno o perdita derivante da qualsiasi uso di queste informazioni. I risultati passati di Morningstar Rating non garantiscono quelli futuri. Per informazioni più dettagliate riguardo a Morningstar Rating, compresa la sua metodologia, si rimanda a: <https://shareholders.morningstar.com/investor-relations/governance/Compliance--Disclosure/default.aspx>

Rating S&P

Copyright 2024, Standard & Poor's Financial Services LLC. Reproduction of S&P Credit Ratings in any form is prohibited except with the prior written permission of Standard & Poor's Financial Services LLC (together with its affiliates, S&P). S&P does not guarantee the accuracy, completeness, timeliness or availability of any information, including ratings, and is not responsible for any errors or omissions (negligent or otherwise), regardless of the cause, or for the results obtained from the use of ratings. S&P GIVES NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, INCLUDING, BUT NOT LIMITED TO, ANY WARRANTIES OF MERCHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE OR USE. S&P shall not be liable for any direct, indirect, incidental, exemplary, compensatory, punitive, special or consequential damages, costs, expenses, legal fees, or losses (including lost income or profits and opportunity costs or losses caused by negligence) in connection with any use of Ratings. S&P's ratings are statements of opinions and are not statements of fact or recommendations to purchase, hold or sell securities. They do not address the market value of securities or the suitability of securities for investment purposes, and should not be relied on as investment advice.

Contatti

Eurizon Capital SGR S.p.A.

Sede Legale: Via Melchiorre Gioia, 22 - 20124 Milano - Italia Tel. +39 02 8810.1 - Fax +39 02 8810 65 00  
Capitale sociale euro 99.000.000,00 i.v. - Codice Fiscale e Iscrizione Registro Imprese di Milano n. 04550250015 - Società partecipante al Gruppo IVA "Intesa Sanpaolo", Partita IVA 11991500015 (IT11991500015) - Iscritta all'Albo delle SGR, al n. 3 nella Sezione Gestori di OICVM e al n. 2 nella Sezione Gestori di FIA - Società soggetta all'attività di direzione e coordinamento di Intesa Sanpaolo S.p.A. ed appartenente al Gruppo Bancario Intesa Sanpaolo, iscritto all'Albo dei Gruppi Bancari. Socio Unico: Intesa Sanpaolo S.p.A. - Aderente al Fondo Nazionale di Garanzia

La presente comunicazione è diretta a fini informativi ai sottoscrittori dei fondi.

La presente informativa non costituisce una comunicazione di marketing né una raccomandazione o suggerimento, implicito o esplicito, rispetto ad una strategia di investimento avente oggetto strumenti finanziari, né una sollecitazione o offerta, né consulenza in materia di investimenti, legale, fiscale o di altra natura. Investire comporta dei rischi: i rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. Il valore dell'investimento e il rendimento che ne deriva, sono soggetti a fluttuazioni, possono aumentare così come diminuire. Di conseguenza, i sottoscrittori dei fondi possono perdere tutto o parte del capitale inizialmente investito. Prima di adottare qualsiasi decisione di investimento ed operare una scelta informata in merito all'opportunità di investire è necessario leggere attentamente le Informazioni Chiave per gli Investitori (KIID), il Prospetto, il Regolamento di gestione e il Modulo di sottoscrizione. Tali documenti descrivono i diritti degli investitori, la natura di questo Fondo, i costi ed i rischi ad esso connessi e sono disponibili gratuitamente sul sito internet [www.eurizoncapital.com](http://www.eurizoncapital.com) nonché presso i distributori. È inoltre possibile ottenere copie cartacee di questi documenti presso la Società di gestione del Fondo su richiesta. I documenti citati sono disponibili in italiano. La Società di Gestione non si assume alcuna responsabilità per l'uso improprio delle informazioni contenute nel presente materiale informativo. Il contenuto della presente comunicazione riporta dati puntuali ed elaborazioni relative alla data in esso indicata. La performance del Fondo riflette gli oneri gravanti sullo stesso e non contabilizzati nell'andamento del benchmark. Le performance del Fondo e del benchmark sono al lordo degli oneri fiscali vigenti.