

È un fondo obbligazionario che presenta un orizzonte temporale di investimento di 3 anni, finalizzato al perseguimento di un rendimento positivo. Il Fondo promuove caratteristiche ambientali e sociali, ai sensi dell'art. 8 del Regolamento (UE) 2019/2088. Per il perseguimento del suo scopo il Fondo investe principalmente in strumenti finanziari obbligazionari di emittenti sovrani, o garantiti da Stati sovrani, e di emittenti societari. Gli emittenti possono essere di qualsiasi categoria e capitalizzazione. Non sono previsti limiti di duration né limiti di rating fermo restando un investimento minimo pari al 30% in titoli Investment Grade

INFORMAZIONI GENERALI

SCHEDA

Categoria Assogestioni	Flessibile
Data di inizio operatività	13/04/2015
ISIN (classe A)	IT0005105199
ISIN (classe B)	IT0005105215
Valuta	EUR
Valorizzazione del NAV	Giornaliera
Depositario	State Street Bank International GmbH Succursale Italia
Società di Gestione	Soprarno SGR S.p.A.

PROFILO RISCHIO / RENDIMENTO



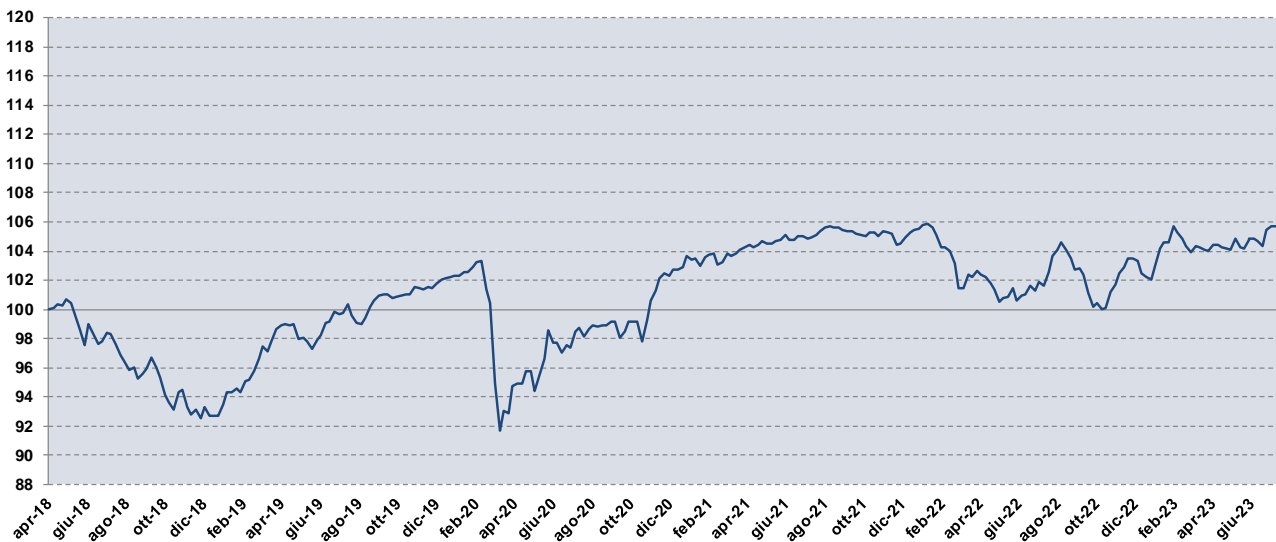
NAV

Nav Classe A	4,507
Nav Classe B	4,840
AuM	€ 40.157.898

Classe	Data Inizio	2023 YTD	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
A	13/04/2015	4,24%	-7,12%	2,71%	0,17%	9,12%	-8,48%	4,34%	-0,24%	-3,76%	N.A.
B	13/04/2015	4,36%	-6,80%	3,39%	0,46%	9,27%	-8,01%	7,23%	1,13%	-2,86%	N.A.

Classe	lug-23	giu-23	mag-23	apr-23	mar-23	feb-23	gen-23	dic-22	nov-22	ott-22	set-22
A	0,76%	0,34%	0,47%	0,66%	-0,07%	-0,47%	2,52%	-1,33%	2,03%	1,16%	-2,43%
B	0,77%	0,36%	0,50%	0,68%	-0,04%	-0,46%	2,52%	-1,31%	2,06%	1,17%	-2,40%

PERFORMANCE



* Il fondo è gestito dall'attuale team dalla partenza

RISCHIO

	Volatilità	Indice di Sharpe	Maximum Draw down	VaR99% 1 mese
FONDO	4,01%	0,25	4,85%	-3,45%

(*) La Downside TEV indica la volatilità delle differenze negative tra i rendimenti giornalieri del fondo e quelli del benchmark. Preso in considerazione insieme alla TEV è possibile capire se gli scostamenti tra rendimenti sono di carattere positivo o negativo. In questo caso sono positivi.

(**) Il Relative VaR è esattamente il VaR_{99%} della differenza tra i rendimenti mensili del fondo e quelli del benchmark; indica dunque lo scostamento massimo negativo che il fondo può avere rispetto al benchmark.

	% Titoli	% Copertura	% Netta
Azioni	0,0%	0,0%	0,0%
Obbligazioni	97,9%	5,3%	103,2%
Liquidità	2,1%	0,0%	2,1%
Altro	0,0%	0,0%	0,0%

Rating	% Titoli
Investment Grade	74,1%
High Yield	17,2%
Non Retato	2,0%

Grado di subordinazione	% Titoli
Subordinati Bancari	17,0%
Subordinati Corporate	2,5%

CARATTERISTICHE

Obbligazioni Governative	22,4%
Obbligazioni Corporate	77,6%
Duration	4,16
Rating	BBB

PRINCIPALI POSIZIONI

BTPS 0 11/29/23	4,49%
BTPS 1 3/4 05/30/24	3,36%
BTPS 0.45 02/15/29	3,23%
CCTS Float 01/15/25	3,11%
BTPS 3 1/2 03/01/30	2,26%
BTPS 2 1/2 12/01/32	2,02%
BTPS 2.15 03/01/2072	1,63%
XOM 1.408 06/26/39	1,52%
UNIIM 3 03/18/25	1,34%
IVSIM 3 10/18/26	1,29%

DURATION DISTRIBUTION

Dur < 1	25,76%
1 <= Dur < 3	27,70%
3 <= Dur < 5	18,17%
5 <= Dur < 7	14,05%
7 <= Dur	14,31%

MATURITY DISTRIBUTION

Yrs to Mty < 1	19,85%
1 <= YrsToMty < 3	24,27%
3 <= Yrs to Mty < 5	17,86%
5 <= Yrs to Mty < 7	16,56%
7 <= Yrs to Mty	21,46%

