

Soprano Pronti Termine Obbligazionario

Dati al 26/06/2026

È un fondo obbligazionario euro governativo di breve termine che ha come obiettivo il contenimento della differenza massima negativa del rendimento del fondo rispetto al parametro di riferimento (MTS BOT) a un livello non superiore allo 0.40% annuo, al fine di preservare il valore del capitale investito. Il portafoglio viene investito in misura prevalente con l'obiettivo di replicare il benchmark e in misura residuale di generare rendimento assoluto, entro i limiti di tracking error annuale fissati mese per mese (anche mediante l'utilizzo di contratti futures). Il Fondo promuove caratteristiche ambientali e sociali, ai sensi dell'art. 8 del Regolamento (UE) 2019/2088.

INFORMAZIONI GENERALI

SCHEDA

Categoria Assogestioni

Obbligazionario euro governativo breve termine

Data di inizio operatività

01/09/2014

ISIN (classe A)

IT0005038648

ISIN (classe B)

IT0004245442

ISIN (classe I)

IT0005436149

Valuta

EUR

Valorizzazione del NAV

Giornaliera

Depositario

State Street Bank International GmbH Succursale Italia

Società di Gestione

L&B Capital sgr

PROFILO RISCHIO / RENDIMENTO

Rischio più basso

←

1

2

3

4

5

6

7

→

Rischio più elevato

NAV

Nav Classe A

5,525

Nav Classe B

6,083

Nav Classe I

5,581

AuM

€ 221.478.688

PERFORMANCE

Classe

Data Inizio

2026 YTD

2025

2024

2023

2022

2021

2020

2019

2018

2017

A

01/09/2014

0,91%

2,57%

3,87%

3,90%

-0,76%

0,14%

0,22%

0,46%

-0,54%

0,08%

B

19/07/2007

1,00%

2,71%

4,05%

4,04%

-0,59%

0,24%

0,37%

0,61%

-0,37%

0,24%

I

17/03/2021

0,98%

2,68%

4,00%

4,02%

-0,62%

0,14%

N.A.

N.A.

N.A.

N.A.

Classe

giu-26

mag-26

apr-26

mar-26

feb-26

gen-26

dic-25

nov-25

ott-25

set-25

ago-25

A

0,18%

0,38%

0,48%

-0,56%

0,16%

0,27%

0,20%

0,18%

0,24%

0,22%

0,26%

B

0,18%

0,40%

0,50%

-0,55%

0,17%

0,30%

0,22%

0,20%

0,25%

0,23%

0,25%

I

0,20%

0,38%

0,51%

-0,56%

0,16%

0,29%

0,22%

0,20%

0,24%

0,24%

0,24%

112

110

108

106

104

102

100

98

set-21

dic-21

mar-22

giu-22

set-22

dic-22

mar-23

giu-23

set-23

dic-23

mar-24

giu-24

set-24

dic-24

mar-25

giu-25

set-25

dic-25

mar-26

giu-26

RISCHIO

Volatilità

Indice di Sharpe

Maximum Drawdown

Excess Return

Beta

TEV

Down TEV*

ReVaR99% 1 mese**

FONDO

0,63%

3,23

-0,60%

0,14%

2,35

0,52%

0,36%

-0,35%

BENCHMARK

0,18%

10,31

-0,07%

(*) 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 VaR99% 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.

Per la classe I del fondo i rendimenti e il NAV si intendono DAL LANCIO (17/03/2021)

ASSET ALLOCATION

	% Titoli	% Copertura	% Netta
Azioni	0,0%	0,0%	0,0%
Obbligazioni	97,4%	-5,1%	92,2%
Liquidità	2,7%	0,0%	2,7%
Altro	0,0%	0,0%	0,0%

	% Divisa	% Copertura	% Netta
USD	0,0%	0,0%	0,0%
JPY	0,0%	0,0%	0,0%
GBP	0,0%	0,0%	0,0%
CHF	0,0%	0,0%	0,0%
EUR	100,0%	0,0%	100,0%
Nord EU	0,0%	0,0%	0,0%
Altro	0,0%	0,0%	0,0%

BOND

CARATTERISTICHE

Obbligazioni Governat. e Agenzie	58,3%
Obbligazioni Corporate	41,7%
Duration	0,78
Rating	BBB

PRINCIPALI POSIZIONI

BTPS 3.8 08/01/28	3,8%
CCTS Float 10/15/31	3,3%
CCTS Float 04/15/33	3,3%
CCTS Float 04/15/34	3,3%
CCTS Float 10/15/30	3,2%
CCTS Float 10/15/28	3,2%
BTPS 2.65 12/01/27	2,9%
FRTR 2.4 09/24/28	2,7%
BTPS 2.7 10/15/27	2,7%
BTPS 2.1 08/26/27	2,7%

DURATION

DURATION DISTRIBUTION

Dur < 1	48,4%
1 <= Dur < 3	51,6%
3 <= Dur < 5	0,0%
5 <= Dur < 7	0,0%
7 <= Dur	0,0%

MATURITY DISTRIBUTION

Yrs to Mty < 1	23,80%
1 <= YrsToMty < 3	60,41%
3 <= Yrs to Mty < 5	3,33%
5 <= Yrs to Mty < 7	6,77%
7 <= Yrs to Mty	5,70%

