

Soprarno Pronti Termine Obbligazionario

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.

Dati al 29/05/2026

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

5,515

Nav Classe B

6,072

Nav Classe I

5,570

AuM

€ 216.683.307

PERFORMANCE

Classe

Data Inizio

2026 YTD

2025

2024

2023

2022

2021

2020

2019

2018

2017

A

01/09/2014

0,73%

2,57%

3,87%

3,90%

-0,76%

0,14%

0,22%

0,46%

-0,54%

0,08%

B

19/07/2007

0,81%

2,71%

4,05%

4,04%

-0,59%

0,24%

0,37%

0,61%

-0,37%

0,24%

I

17/03/2021

0,78%

2,68%

4,00%

4,02%

-0,62%

0,14%

N.A.

N.A.

N.A.

N.A.

Classe

mag-26

apr-26

mar-26

feb-26

gen-26

dic-25

nov-25

ott-25

set-25

ago-25

lug-25

A

0,42%

0,42%

-0,55%

0,16%

0,27%

0,20%

0,18%

0,22%

0,24%

0,11%

0,30%

B

0,45%

0,43%

-0,53%

0,17%

0,30%

0,22%

0,20%

0,23%

0,25%

0,10%

0,32%

I

0,41%

0,43%

-0,52%

0,16%

0,29%

0,22%

0,20%

0,22%

0,26%

0,09%

0,31%

118,00

114,00

110,00

106,00

102,00

98,00

94,00

90,00

set-20

gen-21

mag-21

set-21

gen-22

mag-22

set-22

gen-23

mag-23

set-23

gen-24

mag-24

set-24

gen-25

mag-25

set-25

gen-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)

(*) 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)

	% Titoli	% Copertura	% Netta
Azioni	0,0%	0,0%	0,0%
Obbligazioni	99,9%	-3,5%	96,4%
Liquidità	0,1%	0,0%	0,1%
Altro	0,0%	0,0%	0,0%

CARATTERISTICHE

Obbligazioni Governat. e Agenzie	54,8%
Obbligazioni Corporate	45,2%
Duration	0,94
Rating	BBB

PRINCIPALI POSIZIONI

BTPS 1.6 06/01/26	3,7%
CCTS Float 10/15/31	3,3%
CCTS Float 04/15/33	3,3%
CCTS Float 04/15/34	3,3%
CCTS Float 10/15/28	3,3%
CCTS Float 10/15/30	3,3%
BTPS 2.65 12/01/27	3,0%
BTPS 2.2 06/01/27	2,8%
FRTR 2.4 09/24/28	2,8%
BTPS 2.7 10/15/27	2,8%

DURATION DISTRIBUTION

Dur < 1	50,3%
1 <= Dur < 3	49,7%
3 <= Dur < 5	0,0%
5 <= Dur < 7	0,0%
7 <= Dur	0,0%

MATURITY DISTRIBUTION

Yrs to Mty < 1	25,62%
1 <= YrsToMty < 3	61,12%
3 <= Yrs to Mty < 5	3,29%
5 <= Yrs to Mty < 7	6,67%
7 <= Yrs to Mty	3,31%

