Winton Alma Diversified Macro Fund R1C-E

Categoria Morningstar™
Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

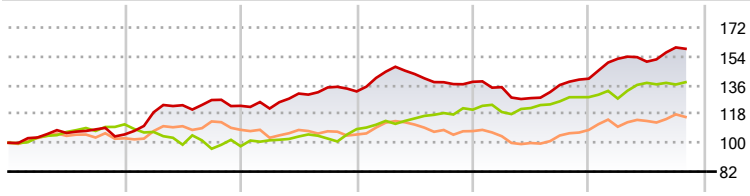
Benchmark Dichiarato
Not Benchmarked

Morningstar Rating™
★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

L'obiettivo di investimento del Fondo è di conseguire un apprezzamento del capitale nel lungo termine attraverso l'esposizione a una gamma di strumenti finanziari (derivati) secondo un sistema di negoziazione computerizzato (Strategia) elaborato da Winton Capital Management Limited (Winton). Tali investimenti possono comprendere derivati collegati a materie prime (ivi compresi, energia, metalli e colture), indici azionari, titoli di debito negoziabili (obbligazioni), tassi di interesse e valute.

Rendimenti



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-10
Fondo	5,21	16,98	7,32	4,54	1,41	13,35
Benchmark e Indici	11,51	-12,28	10,99	11,17	6,48	7,26
Categoria	2,56	7,19	-2,45	0,58	1,14	7,75

Misure di Rischio

3Y Alpha	3,23	3Y Sharpe Ratio	0,42
3Y Beta	-0,03	3Y Std Dev	6,93
3Y R-Squared	0,09	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	-0,58	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	9,41	10Y Risk	-Med

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	2,08	-2,19	-0,17
6-Mesi	0,23	-0,20	-0,65
1-Anno	12,91	6,06	6,03
3-Anni Ann.ti	5,25	8,71	5,10
5-Anni Ann.ti	7,61	3,65	2,06
10-Anni Ann.ti	2,77	5,35	1,44

Rendimenti aggiornati al 19/11/2026

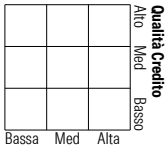
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	8,89	-1,18	5,90	-
2025	-2,42	-5,10	6,42	2,90
2024	9,32	-1,01	-3,57	0,18
2023	-1,36	7,69	2,91	-1,83
2022	13,16	3,71	2,63	-2,87

Portafoglio 30/06/2026

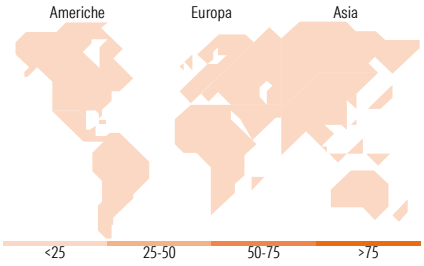


Asset Allocation %	Netta
Azioni	9,64
Obbligazioni	-152,64
Liquidità	234,65
Altro	8,35

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Deutsche Bank AG London Branch	—	8,34
European Investment Bank 0%	—	6,81
United States Treasury Bills...	—	4,58
United States Treasury Bills...	—	4,58
Kreditanstalt Fuer...	—	3,91
United States Treasury Bills...	—	3,83
International Bank for...	—	3,82
United States Treasury Bills...	—	3,82
United States Treasury Bills...	—	3,82
United States Treasury Bills...	—	3,81
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		47,33
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		185

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	-147,18
Societario	9,24
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	217,76
Derivati	20,18

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	0,00
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	**0,00**
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
Europa	**0,00**
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
Asia	**0,00**
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Alma Capital Investment Management S.A.
Telefono	+352 288 454-1
Web	www.almacapital.com
Data di Partenza	14/07/2010
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	15/06/2015
NAV (19/11/2026)	EUR 15.597,86
Patrimonio Netto (Mln) (30/06/2026)	129,80 USD

Patrimonio Classe (Mln) (19/11/2026)	4,43 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0462954800

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	3,38%
Spese correnti	2,35%
Commissione di incentivo	18,00%

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR