Winton Alma Diversified Macro Fund R1C-E

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

**

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR

Usato nel Report

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.

Misure di Rischio)		
3Y Alpha	1,96	3Y Sharpe Ratio	0,22
3Y Beta	-0,09	3Y Std Dev	6,97
3Y R-Squared	0,69	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	-0,38	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	9,84	10Y Risk	-Med
Basati su Morningstar Euro applicabile)	Moderate	Global Target Allocation NR	EUR (dove

imenti						
						154
						136
	·······				·····	118
						100
	······································					82
						82 - 64
2020	2021	2022	2023	2024	2025-11	
2020 -18,06	2021 5,21	2022 16,98	2023 7,32	2024 4,54	2025-11 1,00	
						• Fondo
-18,06	5,21	16,98	7,32	4,54	1,00	- 64

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,14	1,91	1,25	Trimestrali %				
6-Mesi	8,35	5,66	4,18	2025	-2,42	-5,10	6,42	-
1-Anno	-0,06	5,86	2,14	2024	9,32	-1,01	-3,57	0,18
3-Anni Ann.ti	4,36	8,96	1,95	2023	-1,36	7,69	2,91	-1,83
5-Anni Ann.ti	7,04	5,15	2,56	2022	13,16	3,71	2,63	-2,87
10-Anni Ann.ti	0,82	5,22	0,89	2021	3,32	2,73	2,09	-2,90
Rendimenti aggiornati al 17/12/2	2025							

Fondo

0,00

0,00

Portafoglio

Asset Allocation % Ne

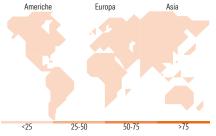
Netta



Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome	Settore	%
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		0,00
Numero Complessivo di Titoli Azionari		-
Numero Complessivo di Titoli Obbligazi	onari	-

₩ Governativo	0,00
Societario	0,00
♠ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	0,00
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
Coupon Range % 0 coupon	Fondo 0,00
-	
0 coupon	0,00
0 coupon Da 0 a 4 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 (17/12/2025)	EUR 13.814,13
Patrimonio Netto (MIn)	-

Patrimonio Classe (MIn)	1,50 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0462954800

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

Da 10 a 12 cedole

Oltre 12 cedole