

Winton Alma Diversified Macro Fund R1C-U

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001012

Benchmark Morningstar

Morningstar US Moderate Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

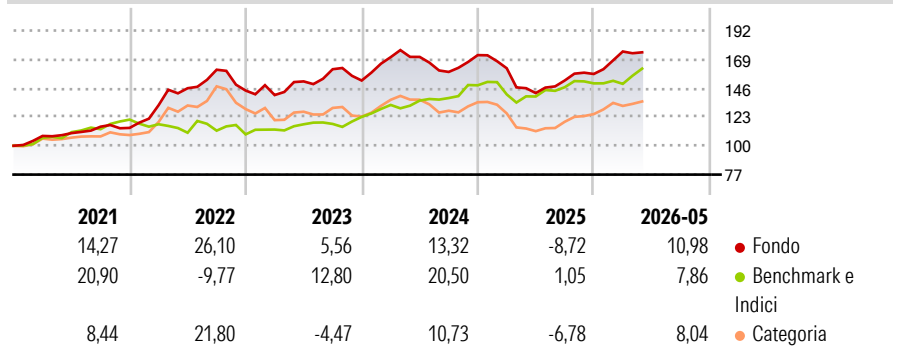
L'obiettivo di investimento del Fondo è di conseguire un apprezzamento del capitale nel lungo termine attraverso l'esposizione a una gamma di strumenti finanziari (derivati) secondo un sistema di negoziazione computerizzato (Strategia) elaborato da Winton Capital Management Limited (Winton). Tali investimenti 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.

Misure di Rischio

3Y Alpha	4,43	3Y Sharpe Ratio	0,24
3Y Beta	-0,10	3Y Std Dev	11,00
3Y R-Squared	1,70	3Y Risk	Basso
3Y Info Ratio	-0,59	5Y Risk	Basso
3Y Tracking Error	11,93	10Y Risk	Basso

Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,97	10,33	3,84
6-Mesi	12,77	9,10	7,80
1-Anno	23,54	17,97	15,81
3-Anni Ann.ti	5,88	12,30	4,09
5-Anni Ann.ti	10,16	8,35	6,87
10-Anni Ann.ti	3,89	9,10	3,31

Rendimenti aggiornati al 22/06/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	11,41	-	-	-
2025	-6,09	-12,21	7,05	3,43
2024	12,25	0,12	-7,01	8,44
2023	-2,50	7,76	6,42	-5,59
2022	15,86	10,23	10,13	-10,35

Portafoglio 31/03/2026



Asset Allocation %

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

Netta

-6,18
-184,3
8
281,28
9,28

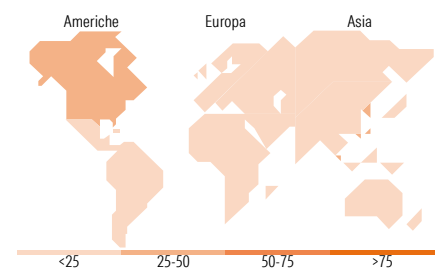
Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Basso, Med, Alta

Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Deutsche Bank AG London Branch	-	9,25
United States Treasury Bills...	-	2,71
United States Treasury Bills...	-	2,71
United States Treasury Bills...	-	2,71
United States Treasury Bills...	-	2,70
United States Treasury Bills...	-	2,70
United States Treasury Bills...	-	2,69
United States Treasury Bills...	-	2,42
S&P TSX 60 Index Future June...	-	2,17
SGX MSCI Singapore Free NTR...	-	1,38
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		31,44
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		195

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	-148,00
Societario	8,72
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	250,52
Derivati	-11,24

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	41,25
Stati Uniti	1,68
Canada	39,43
America Latina e Centrale	0,14
Europa	32,58
Regno Unito	16,12
Europa Occidentale - Euro	15,86
Europa Occidentale - Non Euro	0,48
Europa dell'Est	0,02
Africa	0,04
Medio Oriente	0,06
Asia	26,17
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	25,08
Asia - Emergente	1,09

Anagrafica

Società di Gestione	Alma Capital Investment Management S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	27,59 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 288 454-1	(22/06/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.almacapital.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	3,19%
Data di Partenza	14/07/2010	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	2,34%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	18,00%
Data Inizio Gestione	15/06/2015	Inc/Acc	Acc		
NAV (22/06/2026)	USD 18.401,91	ISIN	LU0462954982		
Patrimonio Netto (Mln)	109,59 USD				

(31/03/2026)

[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 prodotte; (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.