

# JPMorgan Funds - Diversified Risk Fund A (acc) - USD

**Categoria Morningstar™**

Category\_EUCA001010

**Benchmark Morningstar**
Morningstar US Conservative Target  
Allocation NR USD  
Usato nel Report
**Benchmark Dichiarato**

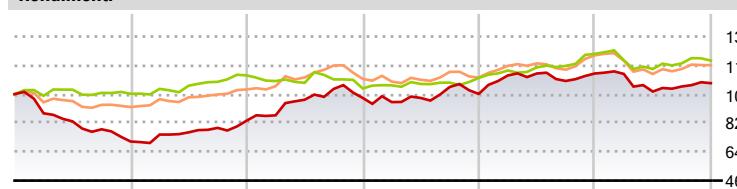
ICE BofA SOFR Overnight Rate TR USD

**Morningstar Rating™**

★★★

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

Il Comparto mira ad offrire la crescita del capitale nel lungo periodo investendo in molteplici classi di attivo su scala globale, impiegando un approccio all'asset allocation ponderato per il rischio e utilizzando strumenti finanziari derivati ove appropriato. La maggior parte degli attivi del Comparto sarà investita, direttamente o tramite strumenti finanziari derivati, in titoli azionari (comprese società a bassa capitalizzazione), titoli convertibili, titoli di debito (compresi i titoli con rating inferiore a investment grande o sprovvisti di rating), valute, liquidità e strumenti equivalenti. Il Comparto può altresì acquisire un'esposizione alle commodity tramite azioni, OICVM o altri OICR, o strumenti finanziari derivati su indici...

**Rendimenti**


| 2020   | 2021  | 2022  | 2023 | 2024  | 2025-12 |
|--------|-------|-------|------|-------|---------|
| -29,59 | 18,51 | 17,03 | 2,53 | 12,76 | -5,34   |
| 0,24   | 11,48 | -7,32 | 6,35 | 13,67 | -3,35   |
| -7,73  | 13,07 | 7,54  | 0,91 | 13,92 | -4,44   |

**Misure di Rischio**

|                   |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | 2,74  | 3Y Sharpe Ratio | 0,05 |
| 3Y Beta           | -0,34 | 3Y Std Dev      | 9,81 |
| 3Y R-Squared      | 13,83 | 3Y Risk         | Med  |
| 3Y Info Ratio     | -0,25 | 5Y Risk         | +Med |
| 3Y Tracking Error | 9,24  | 10Y Risk        | +Med |

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

**Rend. Cumulati %**

|                | Fondo | Bmk   | Cat   |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi         | 3,50  | 1,27  | 3,29  |
| 6-Mesi         | 6,22  | 5,91  | 7,67  |
| 1-Anno         | -6,05 | -1,76 | -2,77 |
| 3-Anni Ann.ti  | 4,45  | 5,35  | 5,62  |
| 5-Anni Ann.ti  | 8,73  | 3,98  | 8,83  |
| 10-Anni Ann.ti | 1,40  | 4,09  | 3,57  |

Rendimenti aggiornati al 14/01/2026

**Rendimenti Trimestrali %**

|      | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | -     | -     | -     | -     |
| 2025 | -0,20 | -9,79 | 3,11  | 1,98  |
| 2024 | 11,51 | 1,13  | -4,14 | 4,31  |
| 2023 | -2,69 | 2,73  | 7,03  | -4,17 |
| 2022 | 3,98  | 11,25 | 6,98  | -5,44 |

**Portafoglio 30/11/2025**

**Asset Allocation %**

| ● Azioni       | 50,56 |
|----------------|-------|
| ● Obbligazioni | 30,04 |
| ● Liquidità    | 18,85 |
| ● Altro        | 0,55  |

**Fixed Income Style**

| Box™                 | Duration Effettiva    | Fondo |
|----------------------|-----------------------|-------|
|                      | Maturity effettiva    |       |
|                      | Qualità Credito Media |       |
| Alto                 | -                     | -     |
| Medio                | -                     | -     |
| Basso                | -                     | -     |
| Ambientale           | -                     | -     |
| Sensibilità ai Tassi | -                     | -     |

**Americhe**

**Europa**

**Asia**

**Titoli principali**

| Nome  | Settore | %    |
|---|---------|------|
| JPM USD Liquidity LNAV X...                 | -       | 7,55 |
| United States Treasury Bills...             | -       | 3,67 |
| United States Treasury Bills...             | -       | 3,61 |
| United States Treasury Bills...             | -       | 3,55 |
| BAR PORTFOLIO SWAP USD                      | -       | 0,73 |
| Thor Industries Inc. 4%                     | -       | 0,54 |
| ON Semiconductor Corp. 3.875%               | -       | 0,54 |
| Boise Cascade Co 4.875%                     | -       | 0,53 |
| Trinet Group Inc 3.5%                       | -       | 0,53 |
| Pitney Bowes Inc. 6.875%                    | -       | 0,52 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            | 21,77   |      |
| Numeri Complessivo di Titoli Azionari       | 344     |      |
| Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari | 142     |      |

**Fixed Income Sector Weightings %**

|                          | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo              | 23,22 |
| Societario               | 53,15 |
| Cartolarizzazioni        | 0,00  |
| Enti Locali              | 0,00  |
| Liquidità ed equivalenti | 23,18 |
| Derivati                 | 0,46  |

**Coupon Range %**

|                   | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 12,02 |
| Da 0 a 4 cedole   | 15,03 |
| Da 4 a 6 cedole   | 30,77 |
| Da 6 a 8 cedole   | 23,41 |
| Da 8 a 10 cedole  | 14,05 |
| Da 10 a 12 cedole | 3,47  |
| Oltre 12 cedole   | 1,26  |

**Ripartizione Geografica %**

|                               | Fondo        |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>76,22</b> |
| Stati Uniti                   | 70,45        |
| Canada                        | 5,30         |
| America Latina e Centrale     | 0,46         |
| <b>Europa</b>                 | <b>1,10</b>  |
| Regno Unito                   | 0,05         |
| Europa Occidentale - Euro     | 0,03         |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,40         |
| Europa dell'Est               | 0,00         |
| Africa                        | 0,00         |
| Medio Oriente                 | 0,63         |
| <b>Asia</b>                   | <b>22,68</b> |
| Giappone                      | 19,00        |
| Australasia                   | 3,12         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 0,00         |
| Asia - Emergenti              | 0,55         |

**Anagrafica**

|                     |   |                         |              |                              |       |
|---------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione | JPMorgan Asset Management (Europe) S.p.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 1,93 USD     | Investimento Min. Ingresso   | -     |
|                     | r.l.                                      | (14/01/2026)            |              | Investimento Min. Successivo | -     |
| Domicilio           |   |                         | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | 1,55% |
| Valuta del Fondo    |   |                         | USD          | Spese correnti               | 1,55% |
| UCITS               |   |                         | Si           | Commissione di incentivo     | -     |
| Inc/Acc             |   |                         | Acc          |                              |       |
| ISIN                |   |                         | LU0875415688 |                              |       |

## JPMorgan Funds - Diversified Risk Fund A (acc) - USD

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| Data di Partenza       | 08/02/2013    |
| Nome del Gestore       | Yazann Romahi |
| Data Inizio Gestione   | 08/02/2013    |
| NAV (14/01/2026)       | USD 134,88    |
| Patrimonio Netto (Mln) | 377,54 USD    |

(30/11/2025)