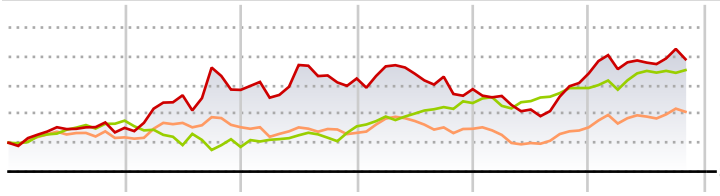
# Nomura Cross Asset Momentum UCITS Fund Class I EUR

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Alt - Systematic Futures | Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR<br>Usato nel Report | N/A | ★★★ |

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective of the Portfolio is to produce capital growth over the long-term through an exposure to the momentum of multiple asset classes and financial instruments. The Portfolio will seek to achieve this objective by providing Shareholders with a return obtained from exposing up to 100% of the Portfolio's net assets to the performance of a diversified portfolio capturing the momentum of various asset classes and financial instruments (the "Momentum Portfolio").

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | 7,77 | 18,33 | 4,66 | -4,15 | 6,43 | 5,39 |
| 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 | -2,13 | 3Y Sharpe Ratio | 0,07 |
| 3Y Beta | 0,37 | 3Y Std Dev | 10,89 |
| 3Y R-Squared | 4,26 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,70 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 11,38 | 10Y Risk | Med |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -2,29 | -2,19 | -0,17 |
| 6-Mesi | -3,07 | -0,20 | -0,65 |
| 1-Anno | 10,03 | 6,06 | 6,03 |
| 3-Anni Ann.ti | 2,56 | 8,71 | 5,10 |
| 5-Anni Ann.ti | 4,88 | 3,65 | 2,06 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,09 | 5,35 | 1,44 |

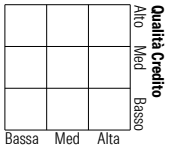
Rendimenti aggiornati al 19/11/2026

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 1,61 | 2,45 | 5,05 | - |
| 2025 | -2,77 | -5,68 | 5,75 | 9,75 |
| 2024 | 4,74 | -2,72 | -1,16 | -4,82 |
| 2023 | -3,17 | 13,77 | -3,86 | -1,18 |
| 2022 | 9,26 | 5,94 | 11,57 | -8,37 |

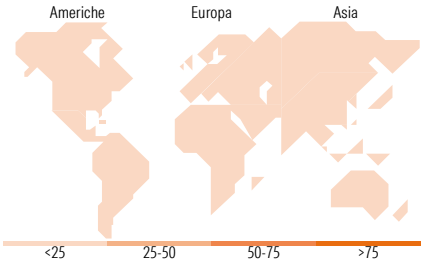
## Portafoglio -

| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|

**Fixed Income Style Box™**




| Fixed Income Style Box™ | 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 Obbligazionari | | - |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 0,00 |
| Derivati | 0,00 |

| 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 | Nomura Alternative Investment Management France S.A.S. |
| Telefono | - |
| Web | - |
| Data di Partenza | 29/03/2016 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 10/03/2019 |
| NAV (19/11/2026) | EUR 116,92 |
| Patrimonio Netto (Mln) | - |
| Patrimonio Classe (Mln) (19/11/2026) | 0,89 EUR |
| Domicilio | IRLANDA |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | IE00BZ1G5M86 |
| Investimento Min. Ingresso | 100.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | 50.000 EUR |
| T.E.R. | - |
| Spese correnti | 0,17% |
| Commissione di incentivo | - |

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