

Fulcrum UCITS SICAV - Fulcrum Diversified Absolute Return Fund I GBP Acc

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001006

Benchmark Morningstar

Morningstar UK Cautious Target Allocation

NR GBP

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

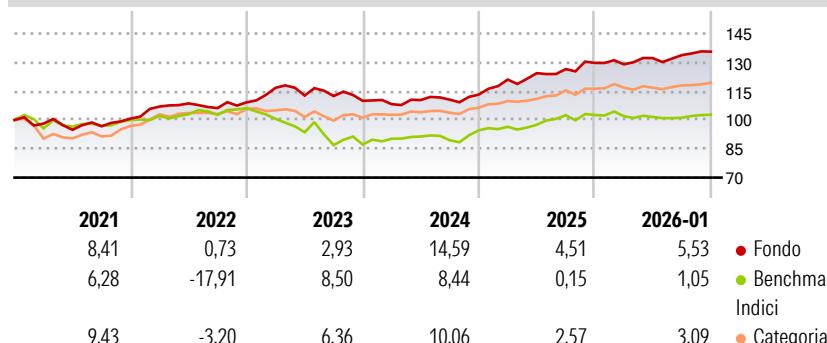
Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund seeks to achieve long-term absolute returns of 3% to 5% over the SOFR interest rate in all market conditions over rolling five year annualised periods, with lower volatility than equity markets. In doing so the Sub-Fund aims to achieve a positive return on a rolling three year basis. However, a positive return is not guaranteed and a capital loss may occur.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	3,79	3Y Sharpe Ratio	1,01
3Y Beta	0,48	3Y Std Dev	5,92
3Y R-Squared	15,58	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,82	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,97	10Y Risk	-

Basati su Morningstar UK Cautious Target Allocation NR GBP (dove applicabile)

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,44	2,03	3,55
6-Mesi	10,61	3,73	7,21
1-Anno	9,44	1,77	4,08
3-Anni Ann.ti	8,98	4,94	6,53
5-Anni Ann.ti	6,73	0,69	4,38
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-0,58	2,50	1,18	1,36
2024	6,91	2,75	1,72	2,54
2023	-1,60	1,98	0,18	2,40
2022	6,97	-3,49	-0,22	-2,21

Portafoglio 31/12/2025

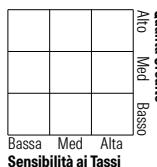


Asset Allocation %

• Azioni	74,70
• Obbligazioni	94,47
• Liquidità	-92,18
• Altro	23,01

Fixed Income Style

Box™

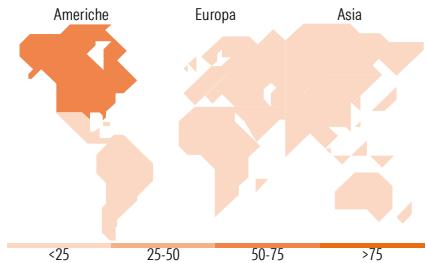


Fondo

Duration Effettiva

Maturity effettiva

Qualità Credito Media



Titoli principali

Nome	Settore	%
10 Year Treasury Note Future...	-	17,51
E-mini S&P 500 Future Mar 26	-	14,05
Put On E-mini S&P 500...	-	9,29
FTSE 100 Index Future Mar 26	-	6,71
Future on 10 Year Japanese...	-	6,70
Willow No.2 (Cayman) Limited...	-	5,77
Willow No 2 (Ireland) PLC 0%	-	5,77
2 Year Treasury Note Future...	-	5,77
Option on Y.A.C.Holdings Co...	-	5,58
Japan (Government Of) 0%	-	4,66
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	81,81	
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	326	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	72	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Governativo	-1,64
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-4.932,91
Derivati	-7,97

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	65,93
Stati Uniti	63,63
Canada	2,25
America Latina e Centrale	0,05
Europa	18,07
Regno Unito	15,21
Europa Occidentale - Euro	1,87
Europa Occidentale - Non Euro	0,82
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,17
Medio Oriente	0,00
Asia	16,00
Giappone	15,39
Australasia	0,13
Asia - Paesi Sviluppati	0,41
Asia - Emergenti	0,07

Anagrafica

Società di Gestione	Fulcrum Asset Management LLP	Patrimonio Classe (Mln)	53,90 GBP	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+44 20 70166450	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.fulcrumasset.com	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	-
Data di Partenza	01/02/2017	UCITS	Si	Spese correnti	0,93%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/02/2017	ISIN	LU1551069211		
NAV (02/02/2026)	GBP 147,07				
Patrimonio Netto (Mln)	1.313,07 USD				
(31/12/2025)					