## Systematica UCITS Fund ICAV - Systematica Liquid Multi Strategy Fund Class C USD

<u>Categ</u>oria Morningstar™ Nory\_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Randimenti

**Benchmark Dichiarato** N/A

Morningstar Rating™

Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD

Usato nel Report

Senza rating

## **Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

The primary objective of the Fund is to seek to achieve long-term appreciation in the value of its assets. The Fund seeks to achieve its investment objective by investing globally in a diversified portfolio of equities, U.S. treasuries and the FDIs listed in the table below, including those giving exposure to equities and U.S. treasuries. The equities and U.S. treasuries in which the Fund invests are listed or traded on Recognised Markets. The Fund may invest in currencies and the FDIs listed in the FDI table below for both hedging and investment purposes. In order to enable the Fund to meet its daily funding requirements, the Fund may also invest in cash and cash equivalents (including treasury bills, bank deposits, deposit certificates...

|         |      |  |                |                |         | 139   |
|---------|------|--|----------------|----------------|---------|---|
|         |      |  |                |                |         | 126   |
|         |      |  |                |                | 7       | 113   |
| ······~ |      | ······································ |                |                | ا       | 100   |
|         |      |  |                | <del></del>    |         | 87  |
|         |      |  |                |                |         | <b>-</b> 74                                 |
| 2017    | 2018 | 2019                                   | 2020           | 2021           | 2022-05 |   |
|         |      |  |                |                |         |   |
| -       | 0,44 | 6,26                                   | -17,26         | 19,05          | 7,53    | <ul><li>Fondo</li></ul>                     |
| -       | 0,44 | 6,26<br>-                              | -17,26<br>0,24 | 19,05<br>11,48 | 7,53    | <ul><li>Fondo</li><li>Benchmark e</li></ul> |
| -       | 0,44 | 6,26<br>-                              |                |                |         |   |

| Misure di Rischio        | )         |                           |           |
|--------------------------|-----------|---------------------------|-----------|
| 3Y Alpha                 | 1,09      | 3Y Sharpe Ratio           | 0,38      |
| 3Y Beta                  | 0,16      | 3Y Std Dev                | 11,39     |
| 3Y R-Squared             | 1,27      | 3Y Risk                   | -         |
| 3Y Info Ratio            | -0,13     | 5Y Risk                   | -         |
| 3Y Tracking Error        | 9,57      | 10Y Risk                  | -         |
| Basati su Morningstar US | Conservat | tive Target Allocation NR | USD (dove |

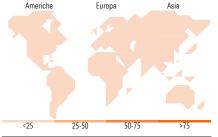
| Rend. Cumulati %                                     | Fondo   | Bmk  | Cat  | Rendimenti    | Q1    | Q2   | Q3   | Q4   |
|--|---------|------|------|---------------|-------|------|------|------|
| 3-Mesi   | 12,01   | 2,91 | 2,83 | Trimestrali % |       |      |      |      |
| 6-Mesi   | 12,17   | 5,88 | 3,07 | 2025          | -     | -    | -    | -    |
| 1-Anno   | 22,41   | 3,02 | 2,84 | 2024          | -     | -    | -    | -    |
| 3-Anni Ann.ti  | 3,46    | 3,90 | 2,99 | 2023          | =     | -    | -    | -    |
| 5-Anni Ann.ti  | -       | 4,00 | 8,91 | 2022          | -1,01 | -    | -    | -    |
| 10-Anni Ann.ti<br>Rendimenti aggiornati al 17/05/200 | -<br>22 | -    | -    | 2021          | 4,52  | 5,41 | 0,59 | 7,42 |

## Portafoglio

Asset Allocation % Netta **Fixed Income Style** Box™ Qualità Credito
Alto Med B Med Alta

Sensibilità ai Tassi

Fondo **Duration Effettiva** Maturity effettiva Qualità Credito Media



| Nome  | Settore | %    |
|---|---------|------|
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio  |         | 0,00 |
| Numero Complessivo di Titoli Azion<br>Numero Complessivo di Titoli Obblig |         | -    |

| 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  | Systematica Investments | Patrimonio Classe (MIn) | 0,68 USD     | Investimento Min. Ingresso   | 200.000.000 USD |
|                      | Limited                 | (17/05/2022)            |              | Investimento Min. Successivo | 10.000 USD      |
| Telefono             | 44 (0)15 3484 1090      | Domicilio               | IRLANDA      | T.E.R.                       | 0,23%           |
| Web                  | www.systematica.com     | Valuta del Fondo        | USD          | Spese correnti               | 0,90%           |
| Data di Partenza     | 08/11/2017              | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -               |
| Nome del Gestore     | -                       | Inc/Acc                 | Acc          |                              |                 |
| Data Inizio Gestione | 08/11/2017              | ISIN                    | IE00BD9PX856 |                              |                 |

## Systematica UCITS Fund ICAV - Systematica Liquid Multi Strategy Fund Class C USD

NAV (17/05/2022) Ar Donio Netto (MIn) USD 98,33

