

Fulcrum UCITS SICAV - Fulcrum Diversified Absolute Return Fund I USD Inc

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001007

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target
Allocation NR USD
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

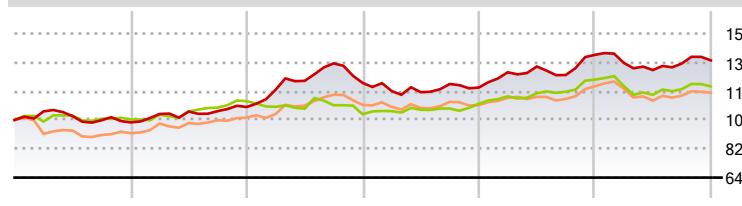
Morningstar Rating™

★★★

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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01
9,76	13,89	-2,34	16,96	-2,42	3,50
11,48	-7,32	6,35	13,67	-3,35	-0,59
10,19	8,94	1,33	10,74	-2,77	1,05

Misure di Rischio

3Y Alpha	2,77	3Y Sharpe Ratio	0,35
3Y Beta	0,37	3Y Std Dev	8,04
3Y R-Squared	17,07	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,20	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	5,70	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %

Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,65	-0,92
6-Mesi	8,10	2,83
1-Anno	-0,83	-3,82
3-Anni Ann.ti	5,54	4,70
5-Anni Ann.ti	7,15	3,56
10-Anni Ann.ti	-	4,62

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-3,53	-3,32	3,10	1,49
2024	7,94	2,77	-3,97	9,80
2023	-4,11	-0,62	4,35	-1,80
2022	9,99	4,66	8,76	-9,03

Portafoglio 31/12/2025

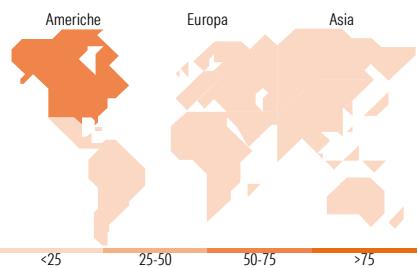


Asset Allocation %	Netta
• Azioni	74,70
• Obbligazioni	94,47
• Liquidità	-92,18
• Altro	23,01

Fixed Income Style

Box™	Duration Effettiva	Fondo
	Maturity effettiva	
	Qualità Credito Media	
Altro	-	-
Med	-	-
Basso	-	-
Med	-	-
Alto	-	-

Sensibilità ai Tassi



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) (03/02/2026)	3,84 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+44 20 70166450	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.fulcrumasset.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	13/04/2018	UCITS	Si	Spese correnti	0,93%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/02/2017	ISIN	LU1561566479		
NAV (03/02/2026)	USD 146,24				
Patrimonio Netto (Mln)	1.313,07 USD				
(31/12/2025)					

© 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 produttori; (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.