

Quantica Managed Futures UCITS I5C-E

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

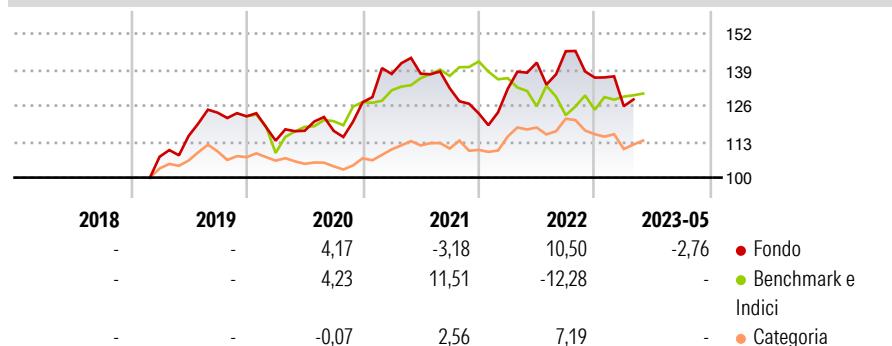
No benchmark

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Investment Objective of the Sub-Fund is capital appreciation. To achieve the Investment Objective, Quantica Capital AG (the "Investment Manager") intends to gain exposure to global exchange-traded futures and forward markets on equity indices, bonds, interest rates, commodities and currencies, all in accordance with Quantica's proprietary systematic investment strategy.

Rendimenti

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | 6,44 | 3Y Sharpe Ratio | 0,38 |
| 3Y Beta | -0,34 | 3Y Std Dev | 13,12 |
| 3Y R-Squared | 5,11 | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | 0,03 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 17,30 | 10Y Risk | - |

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

Rend. Cumulati %

| Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|-------|------|
| 3-Mesi | -3,09 | 1,65 |
| 6-Mesi | -4,33 | 6,69 |
| 1-Anno | -3,17 | 6,10 |
| 3-Anni Ann.ti | 4,27 | 8,37 |
| 5-Anni Ann.ti | - | 3,28 |
| 10-Anni Ann.ti | - | 2,55 |

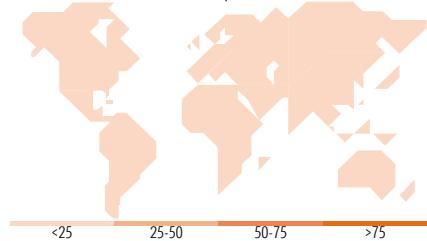
Rendimenti aggiornati al 30/05/2023

Rendimenti Trimestrali %

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|------|------|-------|
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | - | - | - | - |
| 2023 | -7,58 | - | - | - |
| 2022 | 7,22 | 7,15 | 2,91 | -6,54 |

Portafoglio -
Asset Allocation %
Netta
Fixed Income Style
Box™


Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo
Americhe
Europa
Asia

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 %

| | |
|--------------------------|------|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 0,00 |
| Derivati | 0,00 |

Fondo
Ripartizione Geografica %
America
Fondo

Stati Uniti

Canada

America Latina e Centrale

Europa
Fondo

Regno Unito

Europa Occidentale - Euro

Europa Occidentale - Non Euro

Europa dell'Est

Africa

Medio Oriente

Asia
Fondo

Giappone

Australasia

Asia - Paesi Sviluppati

Asia - Emergenti

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---|---|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione | Alma Capital Investment Management S.A. | Patrimonio Classe (Mln) (30/05/2023) | 0,60 EUR | Investimento Min. Ingresso | 5.000.000 EUR |
| Telefono | +352 288 454-1 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | 5.000.000 EUR |
| Web | www.almacapital.com | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 22/02/2019 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,77% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | 10,00% |
| Data Inizio Gestione | 07/08/2015 | ISIN | LU1869436359 | | |
| NAV (30/05/2023) | EUR 1.318,60 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | - | | | | |