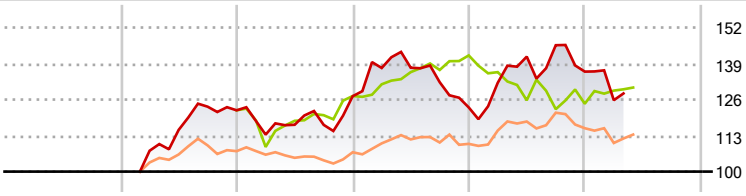
# Quantica Managed Futures UCITS I5C-E

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Alt - Systematic Futures | Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR<br>Usato nel Report | No benchmark | 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




| 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023-05 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| - | - | 4,17 | -3,18 | 10,50 | -2,76 | Fondo |
| - | - | 4,23 | 11,51 | -12,28 | - | Benchmark e Indici |
| - | - | -0,07 | 2,56 | 7,19 | - | Categoria |

## 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 | 1,91 | 1,25 |
| 6-Mesi | -4,33 | 5,66 | 4,18 |
| 1-Anno | -3,17 | 5,86 | 2,14 |
| 3-Anni Ann.ti | 4,27 | 8,96 | 1,95 |
| 5-Anni Ann.ti | - | 5,15 | 2,56 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 30/05/2023

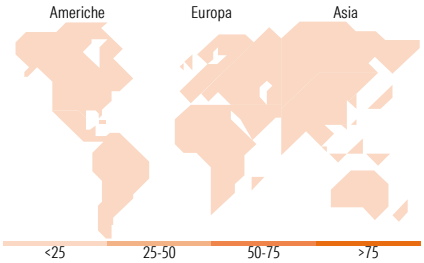
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | - | - | - | - |
| 2023 | -7,58 | - | - | - |
| 2022 | 7,22 | 7,15 | 2,91 | -6,54 |
| 2021 | 8,01 | 0,07 | -3,82 | -6,88 |

## Portafoglio -

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

**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 | Alma Capital Investment Management S.A. |
| Telefono | +352 288 454-1 |
| Web | www.almacapital.com |
| Data di Partenza | 22/02/2019 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 07/08/2015 |
| NAV (30/05/2023) | EUR 1.318,60 |
| Patrimonio Netto (Mln) | - |

| | |
|---|---|
| Patrimonio Classe (Mln) (30/05/2023) | 0,60 EUR |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU1869436359 |

| | |
|---|---|
| Investimento Min. Ingresso | 5.000.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | 5.000.000 EUR |
| T.E.R. | - |
| Spese correnti | 0,77% |
| Commissione di incentivo | 10,00% |

© 2025 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.