

H2O Allegro FCP EUR IC

Categoria Morningstar™

Alt - Global Macro

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

€STR capitalisé Jour TR EUR

Morningstar Rating™

★★★★★

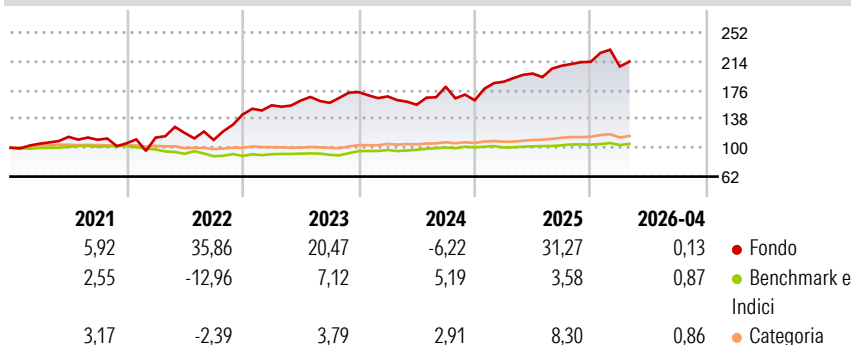
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective is to outperform - the daily capitalized EONIA rate by 2.1% for EUR-SR units, by 2.5% for EUR-R units, by 2.9% for EUR-N units and by 3% for the two EUR-I units; - the GBP 1-month LIBOR by 2.95% for HGBP-I units and by 3% for HGBP-IC (PRF) units; - the CHF 1-month LIBOR by 2.1% for HCHF-SR units, by 2.5% for HCHF-R units and by 3% for HCHF-I units; - the USD 1-month LIBOR by 2.1% for HUSD-SR units, by 2.5% for HUSD-R units, by 2.9% for HUSD-N units and by 3% for HUSD-I units; - the 1-month SGD SIBOR by 2.1% for HSGD-SR units, by 2.5% for HSGD-R units and by 3% for HSGD-I units; - the JPY 1-month LIBOR by 3% for HJPY-IC units; by implementing a management process based upon strategic and tactical positions, as...

Misure di Rischio

3Y Alpha	5,93	3Y Sharpe Ratio	0,64
3Y Beta	1,85	3Y Std Dev	14,04
3Y R-Squared	29,70	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,56	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	12,31	10Y Risk	-

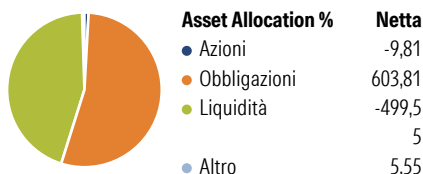
Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rendimenti


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,67	0,49	-0,22
6-Mesi	4,21	1,52	2,78
1-Anno	13,95	4,83	7,65
3-Anni Ann.ti	11,72	4,74	4,81
5-Anni Ann.ti	15,33	1,04	1,68
10-Anni Ann.ti	11,37	2,02	2,03

Rendimenti aggiornati al 06/05/2026

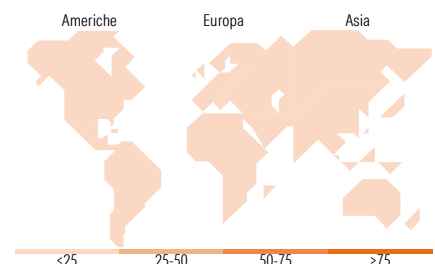
Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	-2,91	-	-	-
2025	15,10	5,73	5,23	2,50
2024	-3,24	-6,55	15,17	-9,96
2023	8,42	3,96	-1,81	8,84
2022	7,06	5,49	-7,74	30,39

Portafoglio 30/06/2025

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito	
Alto	Basso
Alta	Alta
Med	Med
Bassa	Bassa

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo

Titoli principali

Nome	Settore	%
2 Year Treasury Note Future...	-	477,13
Long-Term Euro BTP Future...	-	65,46
Euro Bund Future Sept 25	-	38,13
Long Gilt Future Sept 25	-	32,52
Mexico (United Mexican...	-	15,33
France (Republic Of) 0%	-	9,79
Mexico (United Mexican...	-	8,86
South Africa (Republic of)...	-	8,39
France (Republic Of) 0%	-	7,98
Mexico (United Mexican...	-	5,48
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		669,08
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		36

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	527,56
🏢 Societario	3,09
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏘️ Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	-539,76
📄 Derivati	-0,78

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	H2O AM Europe	Patrimonio Classe (Mln)	44,06 EUR	Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Telefono	-	(06/05/2026)		Investimento Min. Successivo	1/10.000 Quota
Web	-	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	-
Data di Partenza	08/10/2020	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,89%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	25,00%
Data Inizio Gestione	-	Inc/Acc	Acc		
NAV (06/05/2026)	EUR 271.447,26	ISIN	FR0011006188		

H2O Allegro FCP EUR IC

Patrimonio Netto (Mln) 212,20 EUR

(30/06/2025)