## JPMorgan Funds - Multi-Manager Alternatives Fund I2 (acc) - USD

Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001010

**Benchmark Morningstar** 

Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report **Benchmark Dichiarato** 

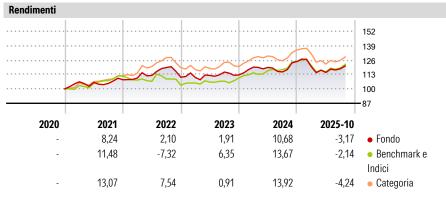
ICE BofA SOFR Overnight Rate TR USD

Morningstar Rating™

\*\*\*

## **Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

To provide long-term capital appreciation by investing in multiple eligible asset classes globally, employing a variety of non-traditional or alternative strategies and techniques, using derivatives where appropriate.



| Misure di Rischio                     |          |                           |             |
|---------------------------------------|----------|---------------------------|-------------|
| 3Y Alpha                              | -1,12    | 3Y Sharpe Ratio           | -0,28       |
| 3Y Beta                               | 0,39     | 3Y Std Dev                | 8,44        |
| 3Y R-Squared                          | 34,92    | 3Y Risk                   | Med         |
| 3Y Info Ratio                         | -0,78    | 5Y Risk                   | -           |
| 3Y Tracking Error                     | 5,03     | 10Y Risk                  | -           |
| Basati su Morningstar US applicabile) | Conserva | tive Target Allocation NF | R USD (dove |

| Rend. Cumulati %                                | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti    | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|---|-------|-------|-------|---------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi  | 2,51  | 2,73  | 3,71  | Trimestrali % |       |       | -     | -     |
| 6-Mesi  | 0,18  | 2,88  | 2,10  | 2025          | -3,80 | -4,26 | 2,92  | -     |
| 1-Anno  | -2,56 | -1,26 | -1,75 | 2024          | 6,25  | -0,23 | -3,40 | 8,09  |
| 3-Anni Ann.ti                                   | 0,92  | 4,39  | 3,75  | 2023          | -0,18 | 1,66  | 2,74  | -2,24 |
| 5-Anni Ann.ti                                   | -     | -     | -     | 2022          | 1,42  | 2,16  | 6,36  | -7,35 |
| 10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 13/11/2 | -     | -     | -     | 2021          | 6,40  | -0,48 | -0,90 | 3,15  |

Fondo

## Portafoglio 30/09/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media



| Titoli principali                     |         |       |
|---------------------------------------|---------|-------|
| Nome                                  | Settore | %     |
| P34699 qualifier 1                    | _       | 26,93 |
| Advanced Micro Devices Inc            |         | 5,48  |
| Synopsys Inc                          |         | 3,41  |
| Spotify Technology SA                 |         | 3,18  |
| United States Treasury Bills          | -       | 2,72  |
| United States Treasury Bills          | _       | 2,01  |
| United States Treasury Bills          | _       | 1,86  |
| Pegasystems Inc                       |         | 1,11  |
| United States Treasury Bills          | _       | 0,99  |
| Tower Semiconductor Ltd               |         | 0,97  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio      |         | 48,66 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionar  | i       | 128   |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligaz | rionari | 196   |

Nome del Gestore Data Inizio Gestione

| <b>₩</b> Governativo                | 37,04        |
|-------------------------------------|--------------|
| Societario                          | 24,75        |
| ★ Cartolarizzazioni                 | 0,04         |
| Enti Locali                         | 6,82         |
| 🚅 Liquidità ed equivalenti          | 32,42        |
| Derivati                            | -1,07        |
| Coupon Range %                      | Fondo        |
| 0 coupon                            | 56,60        |
| Da 0 a 4 cedole                     | 15,32        |
| Da 4 a 6 cedole                     | 10,94        |
|                                     |              |
| Da 6 a 8 cedole                     | 6,66         |
| Da 6 a 8 cedole<br>Da 8 a 10 cedole | 6,66<br>7,49 |
|                                     |              |
| Da 8 a 10 cedole                    | 7,49         |

| Ripartizione Geografica %     | Fondo |
|-------------------------------|-------|
| America                       | 93,16 |
| Stati Uniti                   | 87,56 |
| Canada                        | 3,38  |
| America Latina e Centrale     | 2,22  |
| Europa                        | 4,45  |
| Regno Unito                   | 0,55  |
| Europa Occidentale - Euro     | 0,32  |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,00  |
| Europa dell'Est               | 0,00  |
| Africa                        | 0,00  |
| Medio Oriente                 | 3,59  |
| Asia                          | 2,38  |
| Giappone                      | 1,63  |
| Australasia                   | 0,00  |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 0,61  |
| Asia - Emergente              | 0,14  |
|                               |       |

| Anagrafica          |                         |                         |              |                              |                 |
|---------------------|-------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------------|
| Società di Gestione | JPMorgan Asset          | Patrimonio Classe (MIn) | 4,39 USD     | Investimento Min. Ingresso   | 100.000.000 USD |
|                     | Management (Europe) S.à | (13/11/2025)            |              | Investimento Min. Successivo | 1.000 USD       |
|                     | r.l.                    | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | 1,49%           |
| Telefono            | +352 34 101             | Valuta del Fondo        | USD          | Spese correnti               | 1,71%           |
| Web                 | http://                 | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -               |
|                     | www.jpmorganassetmana   | Inc/Acc                 | Acc          |                              |                 |
|                     | gement.com              | ISIN                    | LU2264168464 |                              |                 |
| Data di Partenza    | 01/12/2020              |                         |              |                              |                 |

© 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 acuratezza 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.

11/01/2016

## JPMorgan Funds - Multi-Manager Alternatives Fund I2 (acc) - USD

 NAV (13/11/2025)
 USD 116,34

 Patrimonio Netto (MIn)
 399,09 USD

(30/09/2025)

