GMO Global Real Return UCITS Fund E EUR

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

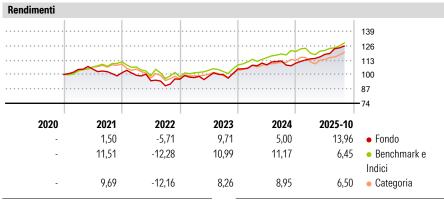
Benchmark Dichiarato

Morningstar Rating™

Morningstar Euro Moderate Global Target OECD G7 Consumer Price Allocation NR EUR Usato nel Report

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of the Fund is to seek to achieve a return in excess of its Benchmark through investment globally in equities, debt, money market instruments, currencies, instruments relating to commodities indices, REITS and related derivatives.



Misure di Rischi	0		
3Y Alpha	4,30	3Y Sharpe Ratio	1,10
3Y Beta	0,61	3Y Std Dev	7,21
3Y R-Squared	30,21	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,31	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	6,59	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Euro applicabile)	o Moderate	Global Target Allocation NI	R EUR (dove

				-				
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	4,34	3,63	3,54	Trimestrali %				
6-Mesi	11,29	6,08	6,44	2025	3,49	3,59	4,95	-
1-Anno	19,56	5,68	5,63	2024	3,19	0,23	3,27	-1,69
3-Anni Ann.ti	10,50	8,05	7,13	2023	1,57	1,39	1,37	5,10
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-2,22	-4,98	-4,77	6,57
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	4,55	0,29	-2,19	-1,02
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

Fondo

Portafoglio 31/10/2025





Distribuzione Settoriale %



Americhe	Eu	ropa	Asia
<25	25-50	50-75	>75

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Contra Derivatives - Swaps	_	25,56
5 Year Treasury Note Future	_	13,68
United States Treasury Notes	_	10,76
United States Treasury Notes	_	10,64
2 Year Treasury Note Future	=	7,65
10 Year Treasury Note Future	_	7,08
Ultra 10 Year US Treasury	_	5,00
E-mini S&P 500 Future Dec 25	_	2,13
Taiwan Semiconductor		1,23
Future on TOPIX	_	1,20
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		84,93
Numero Complessivo di Titoli Azionari	i	1.072
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	319

(31/10/2025)

℃ Ciclico	39,24	
✓ Sensibile	44,42	
→ Difensivo	16,34	
Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	
Governativo	97,85	
Societario	1,29	
★ Cartolarizzazioni	2,88	
Enti Locali	0,00	
Liquidità ed equivalenti	4,22	
Derivati	-6.24	

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	36,90
Stati Uniti	29,50
Canada	5,58
America Latina e Centrale	1,82
Europa	24,51
Regno Unito	4,23
Europa Occidentale - Euro	13,41
Europa Occidentale - Non Euro	4,34
Europa dell'Est	0,93
Africa	0,11
Medio Oriente	1,49
Asia	38,60
Giappone	21,07
Australasia	1,84
Asia - Paesi Sviluppati	8,98
Asia - Emergente	6,71

Anagrafica					
Società di Gestione	GMO	Patrimonio Classe (MIn)	1,34 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+1 617 3307500	(28/11/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.gmo.com	Domicilio	IRLANDA	T.E.R.	-
Data di Partenza	04/12/2020	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,99%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/06/2019	Inc/Acc	Acc		
NAV (28/11/2025)	EUR 25,73	ISIN	IE00BFZZM202		
Patrimonio Netto (MIn)	612,40 USD				