

# Winton Alma Diversified Macro Fund R1C-E

**Categoria Morningstar™**

Alt - Systematic Futures

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

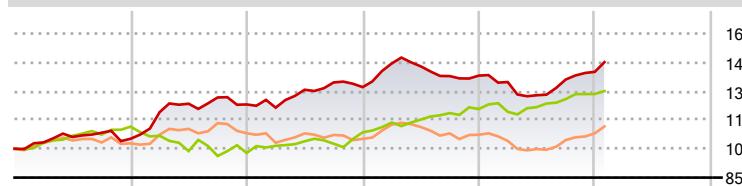
Not Benchmarked

**Morningstar Rating™**

★★★

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

L'obiettivo di investimento del Fondo è di conseguire un apprezzamento del capitale nel lungo termine attraverso l'esposizione a una gamma di strumenti finanziari (derivati) secondo un sistema di negoziazione computerizzato (Strategia) elaborato da Winton Capital Management Limited (Winton). Tali investimenti possono comprendere derivati collegati a materie prime (ivi compresi, energia, metalli e colture), indici azionari, titoli di debito negoziabili (obbligazioni), tassi di interesse e valute.

**Rendimenti**


2021	2022	2023	2024	2025	2026-01	Fondo	Benchmark e Indici	Categoria
5,21	16,98	7,32	4,54	1,41	3,63	● Fondo	● Benchmark e Indici	● Categoria
11,51	-12,28	10,99	11,17	6,48	1,18			
			0,58	1,14	3,32			

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,68	2,10	2,95	2026	-	-	-	-
6-Mesi	13,52	6,24	6,81	2025	-2,42	-5,10	6,42	2,90
1-Anno	6,31	6,02	4,19	2024	9,32	-1,01	-3,57	0,18
3-Anni Ann.ti	6,28	8,83	3,79	2023	-1,36	7,69	2,91	-1,83
5-Anni Ann.ti	7,29	5,09	2,41	2022	13,16	3,71	2,63	-2,87
10-Anni Ann.ti	1,10	6,24	0,89					

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

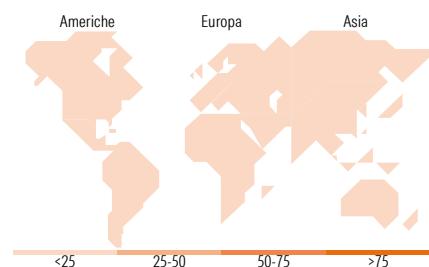
**Misure di Rischio**

3Y Alpha	3,41	3Y Sharpe Ratio	0,41
3Y Beta	-0,08	3Y Std Dev	7,19
3Y R-Squared	0,37	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	-0,30	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	9,36	10Y Risk	-Med

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

**Portafoglio -**
**Asset Allocation %**
**Netta**
**Fixed Income Style**
**Box™**


Duration Effettiva  
Maturity effettiva  
Qualità Credito Media

**Fondo**

**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
Societario
Cartolarizzazioni
Enti Locali
Liquidità ed equivalenti
Derivati

**Ripartizione Geografica %**

Fondo
America
Stati Uniti
Canada
America Latina e Centrale
Europa
Regno Unito
Europa Occidentale - Euro
Europa Occidentale - Non Euro
Europa dell'Est
Africa
Medio Oriente
Asia
Giappone
Australasia
Asia - Paesi Sviluppati
Asia - Emergenti

**Anagrafica**

Società di Gestione	Alma Capital Investment Management S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	1,57 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 288 454-1	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.almacapital.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	14/07/2010	UCITS	Si	Spese correnti	2,18%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	18,00%
Data Inizio Gestione	15/06/2015	ISIN	LU0462954800		
NAV (11/02/2026)	EUR 14.640,21				
Patrimonio Netto (Mln)	-				