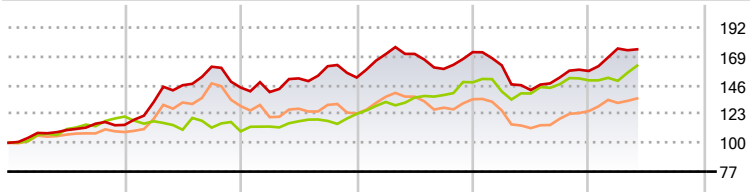
Winton Alma Diversified Macro Fund R1C-U

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001012	Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD Usato nel Report	Not Benchmarked	★★★★

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	2026-05
Fondo	14,27	26,10	5,56	13,32	-8,72	10,98
Benchmark e Indici	20,90	-9,77	12,80	20,50	1,05	7,86
Categoria	8,44	21,80	-4,47	10,73	-6,78	8,04

Misure di Rischio

3Y Alpha	4,43	3Y Sharpe Ratio	0,24
3Y Beta	-0,10	3Y Std Dev	11,00
3Y R-Squared	1,70	3Y Risk	Basso
3Y Info Ratio	-0,59	5Y Risk	Basso
3Y Tracking Error	11,93	10Y Risk	Basso

Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,82	10,21	1,93
6-Mesi	12,04	8,65	6,46
1-Anno	23,17	17,77	14,68
3-Anni Ann.ti	5,42	12,27	3,65
5-Anni Ann.ti	10,02	8,27	6,56
10-Anni Ann.ti	3,67	9,06	3,16

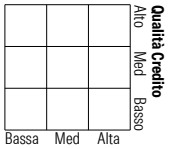
Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	11,41	-	-	-
2025	-6,09	-12,21	7,05	3,43
2024	12,25	0,12	-7,01	8,44
2023	-2,50	7,76	6,42	-5,59
2022	15,86	10,23	10,13	-10,35

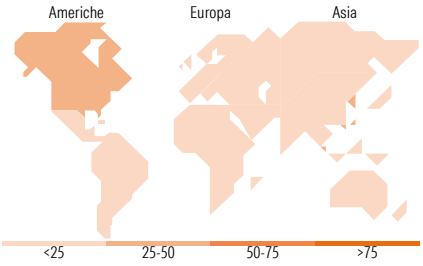
Portafoglio 31/03/2026

Asset Allocation %	Netta
Azioni	-6,18
Obbligazioni	-184,3
	8
Liquidità	281,28
Altro	9,28

Fixed Income Style Box™



Fondo	
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Deutsche Bank AG London Branch	—	9,25
United States Treasury Bills...	—	2,71
United States Treasury Bills...	—	2,71
United States Treasury Bills...	—	2,71
United States Treasury Bills...	—	2,70
United States Treasury Bills...	—	2,70
United States Treasury Bills...	—	2,69
United States Treasury Bills...	—	2,42
S&P TSX 60 Index Future June...	—	2,17
SGX MSCI Singapore Free NTR...	—	1,38

% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	31,44
Numero Complessivo di Titoli Azionari	0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari	195

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	-148,00
Societario	8,72
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	250,52
Derivati	-11,24

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	**41,25**
Stati Uniti	1,68
Canada	39,43
America Latina e Centrale	0,14
Europa	**32,58**
Regno Unito	16,12
Europa Occidentale - Euro	15,86
Europa Occidentale - Non Euro	0,48
Europa dell'Est	0,02
Africa	0,04
Medio Oriente	0,06
Asia	**26,17**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	25,08
Asia - Emergente	1,09

Anagrafica

Società di Gestione	Alma Capital Investment Management S.A.
Telefono	+352 288 454-1
Web	www.almacapital.com
Data di Partenza	14/07/2010
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	15/06/2015
NAV (25/06/2026)	USD 18.179,62
Patrimonio Netto (Mln) (31/03/2026)	109,59 USD

Patrimonio Classe (Mln) (25/06/2026)	27,44 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0462954982

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	3,19%
Spese correnti	2,34%
Commissione di incentivo	18,00%

See disclosures for more details

© 2026 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.

MORNINGSTAR