# Winton Alma Diversified Macro Fund R1C-G

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Category_EUCA001013 | Not Categorized<br>Usato nel Report | Not Benchmarked | Senza 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 | 2026-05 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 12,61 | 12,32 | 11,43 | 11,01 | -2,26 | 11,26 | ● Fondo |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,65 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 7,46 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

| Rend. Cumulati % | Fondo |
|---|---|
| 3-Mesi | 0,60 |
| 6-Mesi | 9,56 |
| 1-Anno | 19,09 |
| 3-Anni Ann.ti | 6,55 |
| 5-Anni Ann.ti | 8,69 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,74 |

Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

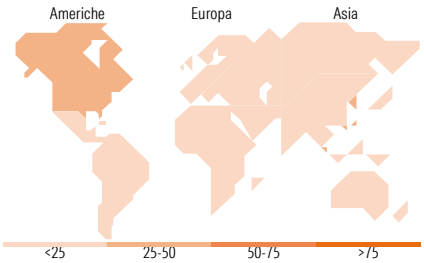
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 9,20 | - | - | - |
| 2025 | -3,16 | -6,89 | 5,05 | 3,18 |
| 2024 | 11,16 | 0,14 | -1,50 | 1,24 |
| 2023 | 0,09 | 10,59 | 2,16 | -1,45 |
| 2022 | 12,83 | 2,02 | 1,07 | -3,45 |

## Portafoglio 31/03/2026

| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| ● Azioni | -6,18 |
| ● Obbligazioni | -184,38 |
| ● 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 | 22/12/2010 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 15/06/2015 |
| NAV (25/06/2026) | GBP 16.072,40 |
| Patrimonio Netto (Mln) (31/03/2026) | 109,59 USD |

| | |
|---|---|
| Patrimonio Classe (Mln) (25/06/2026) | 0,29 GBP |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | GBP |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU0462955013 |

| | |
|---|---|
| Investimento Min. Ingresso | - |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | - |
| Spese correnti | 2,35% |
| 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