

Amundi Metori Epsilon Global Trends Fund A EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

SONIA

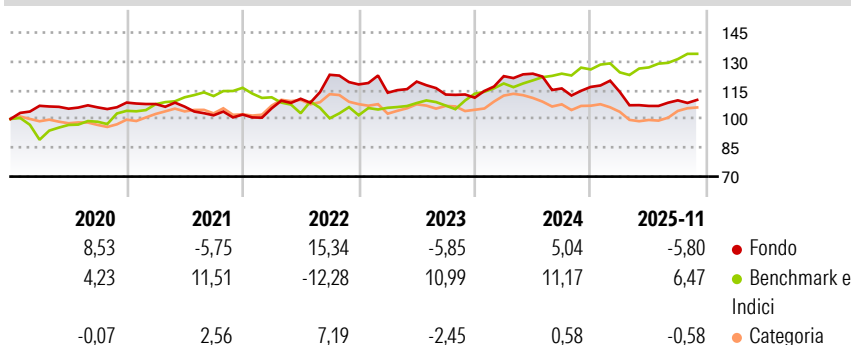
Morningstar Rating™

★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

L'obiettivo del Fondo è quello di conseguire un apprezzamento del capitale nel medio - lungo termine applicando la Lyxor Epsilon Global Trend Strategy. La strategia di investimento Lyxor Epsilon Global Trend Fund fornisce esposizione a diverse classi di attività nei mercati globali (compresi azioni, obbligazioni, tassi d'interesse, volatilità e valute), in base ad un processo di investimento basato su di un modello sistematico. Tale processo mira ad implementare una strategia orientata ad una tendenza che cerca di identificare e sfruttare le tendenze di prezzo al rialzo e al ribasso. Tale processo si basa su segnali quantitativi (alcuni dei quali sono segnali del momentum e della volatilità dei prezzi), abbina fra loro approcci a medio e...

Rendimenti



Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | -7,67 | 3Y Sharpe Ratio | -0,56 |
| 3Y Beta | 0,49 | 3Y Std Dev | 9,38 |
| 3Y R-Squared | 11,11 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -1,14 | 5Y Risk | -Med |
| 3Y Tracking Error | 9,42 | 10Y Risk | -Med |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|------------------|-------|------|------|
| 3-Mesi | 0,96 | 2,67 | 3,42 |
| 6-Mesi | 2,64 | 5,23 | 4,24 |
| 1-Anno | -6,43 | 4,71 | 2,55 |
| 3-Anni Ann.ti | -2,36 | 8,41 | 1,77 |
| 5-Anni Ann.ti | 0,53 | 5,22 | 2,74 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,92 | 5,21 | 0,85 |

Rendimenti aggiornati al 08/12/2025

| Rendimenti | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------------|-------|-------|-------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2025 | -2,24 | -6,40 | 2,73 | - |
| 2024 | 10,08 | 1,05 | -6,21 | 0,68 |
| 2023 | -3,67 | 5,10 | -5,65 | -1,43 |
| 2022 | 3,17 | 4,72 | 11,31 | -4,08 |
| 2021 | -0,68 | -1,26 | -4,25 | 0,37 |

Portafoglio 31/10/2025



Asset Allocation %

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

Netta

47,27
-250,6
6
303,39
0,00

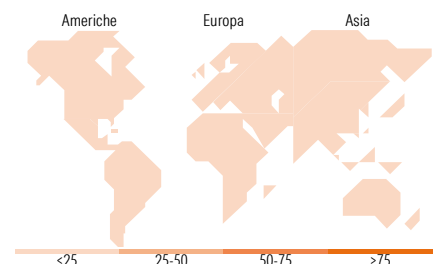
Fixed Income Style

Box™

| Qualità Credito | Alto | Med | Basso |
|----------------------|------|-----|-------|
| Sensibilità ai Tassi | | | |
| Bassa | | | |
| Med | | | |
| Alta | | | |

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| France (Republic Of) 0% | — | 11,84 |
| France (Republic Of) 0% | — | 11,50 |
| France (Republic Of) 0% | — | 10,82 |
| France (Republic Of) 0% | — | 10,15 |
| France (Republic Of) 0% | — | 10,15 |
| France (Republic Of) 0% | — | 9,81 |
| S&P TSX 60 Index Future Dec 25 | — | 9,01 |
| France (Republic Of) 0% | — | 8,10 |
| Future on IBEX 35 Index | — | 7,95 |
| Dax Future Dec 25 | — | 6,60 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 95,93 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 6 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|---------|
| Governativo | -395,03 |
| Societario | 17,78 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 299,70 |
| Derivati | 177,55 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|--------|
| 0 coupon | 100,00 |
| 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 | 0,00 |
| Stati Uniti | - |
| Canada | - |
| America Latina e Centrale | - |
| Europa | 0,00 |
| Regno Unito | - |
| Europa Occidentale - Euro | - |
| Europa Occidentale - Non Euro | - |
| Europa dell'Est | - |
| Africa | - |
| Medio Oriente | - |
| Asia | 0,00 |
| Giappone | - |
| Australasia | - |
| Asia - Paesi Sviluppati | - |
| Asia - Emergente | - |

Anagrafica

| | | | | | |
|----------------------|-------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione | Amundi Asset Management | Patrimonio Classe (Mln) | 7,71 EUR | Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Telefono | +33 1 76 33 30 30 | (08/12/2025) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.amundi-etf.com | Domicilio | IRLANDA | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 31/07/2013 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 1,93% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | 15,00% |
| Data Inizio Gestione | 01/06/2011 | Inc/Acc | Acc | | |
| | | ISIN | IE00B61N8946 | | |

Amundi Metori Epsilon Global Trends Fund A EUR

| | |
|------------------------|------------|
| NAV (08/12/2025) | EUR 160,28 |
| Patrimonio Netto (Mln) | 293,83 EUR |
| (31/10/2025) | |