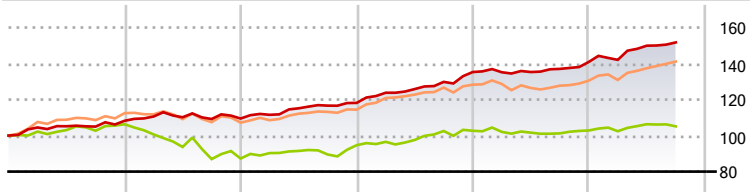
# Mercer Diversifying Alternative Strategies I-1£ Hedged

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Category_EUCA001009 | Morningstar UK Cautious Target Allocation NR GBP<br>Usato nel Report | N/A | Senza rating |

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund's investment objective is to blend a variety of different alternative strategies and asset classes to target attractive low volatility long-term risk adjusted returns. The Sub-Fund is a fund of funds which seeks to achieve its investment objective by investing in a selected group of collective investment schemes (the "Underlying Funds") that are managed by selected specialist investment managers who invest in or who have particular expertise with respect to a specific investment strategy or combination of strategies. To achieve its objective, the Sub-Fund will invest into Underlying Funds and in doing so achieve exposure to alternative investment strategies including some or all of, but not limited to, GTAA/Macro, Currency,...

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-09 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | 8,21 | 1,16 | 7,93 | 14,51 | 4,14 | 7,70 |
| Benchmark e Indici | 6,28 | -17,91 | 8,50 | 8,44 | 0,15 | 2,25 |
| Categoria | 12,06 | -4,13 | 6,76 | 12,59 | 2,12 | 8,45 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | 3,83 | 3Y Sharpe Ratio | 1,61 |
| 3Y Beta | 0,19 | 3Y Std Dev | 3,82 |
| 3Y R-Squared | 9,91 | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | 0,88 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 4,13 | 10Y Risk | - |

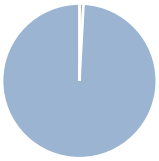
Basati su Morningstar UK Cautious Target Allocation NR GBP (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | 1,21 | 1,85 | 1,85 |
| 6-Mesi | 6,83 | 4,73 | 5,89 |
| 1-Anno | 10,74 | 7,26 | 12,68 |
| 3-Anni Ann.ti | 9,17 | 6,71 | 9,78 |
| 5-Anni Ann.ti | 7,65 | 0,79 | 6,60 |
| 10-Anni Ann.ti | 3,36 | 2,10 | 4,22 |

Rendimenti aggiornati al 30/09/2026

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 0,82 | 5,55 | 1,21 | - |
| 2025 | -0,08 | 0,09 | 1,28 | 2,82 |
| 2024 | 4,77 | 1,66 | 3,17 | 4,22 |
| 2023 | 1,88 | 3,25 | 1,29 | 1,29 |
| 2022 | 2,21 | -0,37 | -0,88 | 0,23 |

## Portafoglio 31/12/2025

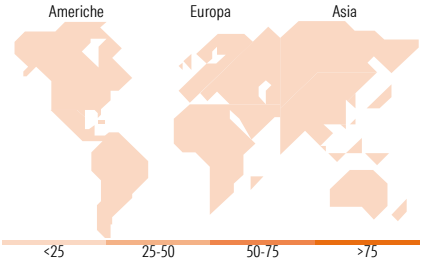


| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 0,00 |
| Liquidità | 0,85 |
| Altro | 99,15 |

**Fixed Income Style Box™**




| | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | - |
| Maturity effettiva | - |
| Qualità Credito Media | |




### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| Sona Credit Fund Limited | — | 8,84 |
| Marshall Wace Managed... | — | 7,87 |
| Brevan Howard Mb Macro Fund... | — | 7,55 |
| Lmr Multi-Strategy Fund... | — | 6,93 |
| Bybrook Capital Fund Limited | — | 6,10 |
| Highbridge Tactical Credit... | — | 5,86 |
| Bridgewater Pure Alpha Major... | — | 5,81 |
| Tudor Riverbend Crossing... | — | 5,35 |
| Greenvale Capital (Cayman)... | — | 5,16 |
| Financial Derivative... | — | 0,62 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 60,08 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 0 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 100,00 |
| Derivati | 0,00 |

| 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** | **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 | MARSH INVESTMENTS FUND MANAGEMENT LIMITED | Patrimonio Classe (Mln) (30/09/2026) | 190,53 GBP | Investimento Min. Ingresso | 250.002 GBP |
| Telefono | - | Domicilio | IRLANDA | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | - | Valuta del Fondo | GBP | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 30/03/2012 | UCITS | No | Spese correnti | - |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| | | ISIN | IE00B7DZBB84 | | |

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

# Mercer Diversifying Alternative Strategies I-1£ Hedged

| | |
|---|---|
| Data Inizio Gestione | 30/03/2012 |
| NAV (30/09/2026) | GBP 158,50 |
| Patrimonio Netto (MIn) (31/12/2025) | 966,72 GBP |

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.