

# JPMorgan Funds - Diversified Risk Fund D (acc) USD

## Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001010

## Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

ICE BofA SOFR Overnight Rate TR USD

## Morningstar Rating™

★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

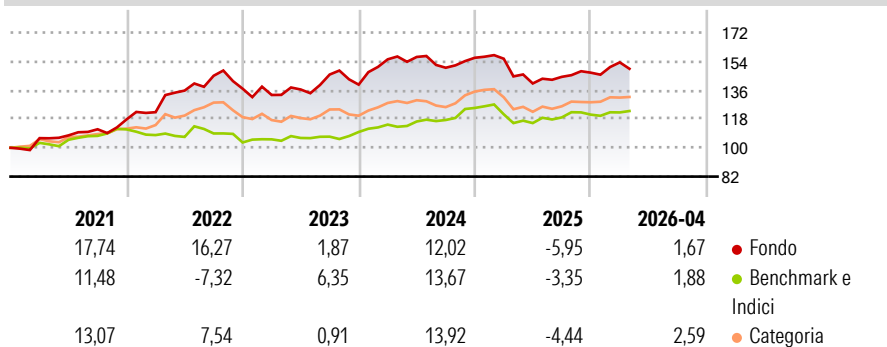
Il Comparto mira ad offrire la crescita del capitale nel lungo periodo investendo in molteplici classi di attivo su scala globale, impiegando un approccio all'asset allocation ponderato per il rischio e utilizzando strumenti finanziari derivati ove appropriato. La maggior parte degli attivi del Comparto sarà investita, direttamente o tramite strumenti finanziari derivati, in titoli azionari (comprese società a bassa capitalizzazione), titoli convertibili, titoli di debito (compresi i titoli con rating inferiore a investment grade o sprovvisti di rating), valute, liquidità e strumenti equivalenti. Il Comparto può altresì acquisire un'esposizione alle commodity tramite azioni, OICVM o altri OICR, o strumenti finanziari derivati su indici...

### Misure di Rischio

|                   |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | 1,77  | 3Y Sharpe Ratio | 0,15 |
| 3Y Beta           | -0,17 | 3Y Std Dev      | 9,19 |
| 3Y R-Squared      | 3,68  | 3Y Risk         | Med  |
| 3Y Info Ratio     | -0,21 | 5Y Risk         | Med  |
| 3Y Tracking Error | 8,27  | 10Y Risk        | +Med |

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

### Rendimenti



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk  | Cat  | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | -1,10 | 2,00 | 2,62 | 2026                     | 4,39  | -     | -     | -     |
| 6-Mesi           | 0,21  | 1,64 | 3,87 | 2025                     | -0,36 | -9,95 | 2,95  | 1,81  |
| 1-Anno           | 0,72  | 6,18 | 6,99 | 2024                     | 11,34 | 0,95  | -4,29 | 4,14  |
| 3-Anni Ann.ti    | 3,53  | 5,80 | 6,91 | 2023                     | -2,84 | 2,56  | 6,85  | -4,32 |
| 5-Anni Ann.ti    | 6,54  | 3,95 | 8,41 | 2022                     | 3,82  | 11,05 | 6,81  | -5,58 |
| 10-Anni Ann.ti   | 1,00  | 4,33 | 4,23 |                          |       |       |       |       |

Rendimenti aggiornati al 08/05/2026

### Portafoglio 31/03/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni           | 49,08 |
| ● Obbligazioni     | 26,47 |
| ● Liquidità        | 23,03 |
| ● Altro            | 1,42  |

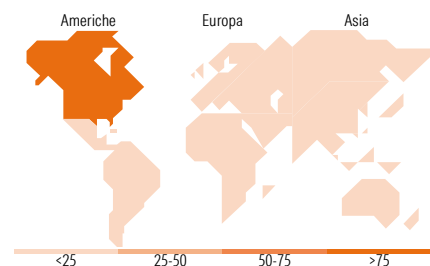
### Fixed Income Style

#### Box™

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

Duration Effettiva -  
Maturità effettiva -  
Qualità Credito Media

### Fondo



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| JPM USD Liquidity LVNAV X...                | -       | 9,45  |
| United States Treasury Bills...             | -       | 4,67  |
| United States Treasury Bills...             | -       | 2,88  |
| United States Treasury Bills...             | -       | 2,86  |
| UBS PORTFOLIO SWAP USD                      | -       | 1,10  |
| Thor Industries Inc. 4%                     | -       | 0,87  |
| Mueller Water Products, Inc....             | -       | 0,79  |
| FMG Resources (August 2006)...              | -       | 0,78  |
| Alliance Resource Operating...              | -       | 0,75  |
| PTC Inc 4%                                  | -       | 0,73  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 24,88 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 337   |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 133   |

### Fixed Income Sector Weightings %

| Fondo                      |       |
|----------------------------|-------|
| 🏛️ Governativo             | 20,30 |
| 🏢 Societario               | 48,57 |
| 🏠 Cartolarizzazioni        | 0,00  |
| 🏘️ Enti Locali             | 0,00  |
| 🏢 Liquidità ed equivalenti | 30,39 |
| 📄 Derivati                 | 0,73  |

### Coupon Range %

| Fondo             |       |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 10,68 |
| Da 0 a 4 cedole   | 14,35 |
| Da 4 a 6 cedole   | 29,87 |
| Da 6 a 8 cedole   | 25,32 |
| Da 8 a 10 cedole  | 13,62 |
| Da 10 a 12 cedole | 3,89  |
| Oltre 12 cedole   | 2,28  |

### Ripartizione Geografica %

| Fondo                         |              |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>75,72</b> |
| Stati Uniti                   | 69,59        |
| Canada                        | 6,13         |
| America Latina e Centrale     | 0,00         |
| <b>Europa</b>                 | <b>0,97</b>  |
| Regno Unito                   | 0,00         |
| Europa Occidentale - Euro     | 0,00         |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,84         |
| Europa dell'Est               | 0,00         |
| Africa                        | 0,00         |
| Medio Oriente                 | 0,12         |
| <b>Asia</b>                   | <b>23,31</b> |
| Giappone                      | 19,38        |
| Australasia                   | 3,07         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 0,00         |
| Asia - Emergente              | 0,86         |

### Anagrafica

|                     |   |                         |              |                              |           |
|---------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione | JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l. | Patrimonio Classe (Mln) | 3,13 USD     | Investimento Min. Ingresso   | 5.000 USD |
| Telefono            | +352 34 101                                 | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | 1.000 USD |
| Web                 | http://www.jpmorganassetmanagement.com      | Valuta del Fondo        | USD          | T.E.R.                       | 2,20%     |
|                     |   | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 2,20%     |
|                     |   | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -         |
|                     |   | ISIN                    | LU0875418195 |                              |           |

# JPMorgan Funds - Diversified Risk Fund D (acc) USD

---

|   |               |
|---|---------------|
| Data di Partenza                                      | 08/02/2013    |
| Nome del Gestore                                      | Yazann Romahi |
| Data Inizio Gestione                                  | 08/02/2013    |
| NAV <small>(08/05/2026)</small>                       | USD 124,69    |
| Patrimonio Netto (Mln)<br><small>(31/03/2026)</small> | 234,08 USD    |