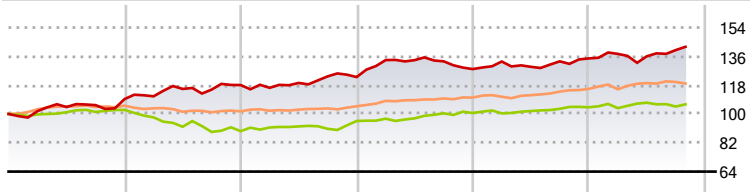
# JPMorgan Funds - Diversified Risk Fund A (acc) EUR (hedged)

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Alt - Multistrategy | Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR<br>Usato nel Report | ICE BofA SOFR Overnight Rate TR USD | ★★★ |

## 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 grande 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...

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | 9,32 | 8,01 | 4,23 | 4,04 | 5,20 | 5,38 |
| Benchmark e Indici | 2,55 | -12,96 | 7,12 | 5,19 | 3,58 | 1,77 |
| Categoria | 4,15 | -2,50 | 3,59 | 5,57 | 4,99 | 2,66 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | 2,23 | 3Y Sharpe Ratio | 0,29 |
| 3Y Beta | -0,22 | 3Y Std Dev | 5,55 |
| 3Y R-Squared | 2,59 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | -0,18 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 7,43 | 10Y Risk | +Med |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | 2,50 | -0,21 | -1,45 |
| 6-Mesi | 4,07 | 0,99 | -0,84 |
| 1-Anno | 5,02 | 2,03 | 3,06 |
| 3-Anni Ann.ti | 3,42 | 5,28 | 5,00 |
| 5-Anni Ann.ti | 6,18 | 0,73 | 2,62 |
| 10-Anni Ann.ti | 0,45 | 2,00 | 2,21 |

Rendimenti aggiornati al 11/11/2026

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 2,11 | -1,08 | 2,84 | - |
| 2025 | 3,70 | -2,49 | 2,63 | 1,37 |
| 2024 | 8,62 | -0,02 | -0,58 | -3,63 |
| 2023 | -1,45 | 2,60 | 3,44 | -0,34 |
| 2022 | 1,57 | 4,16 | -0,36 | 2,47 |

## Portafoglio 30/09/2026

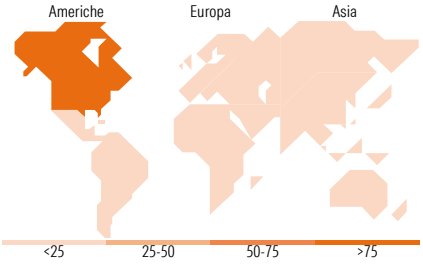


| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 49,24 |
| Obbligazioni | 24,20 |
| Liquidità | 24,51 |
| Altro | 2,05 |

**Fixed Income Style Box™**




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




| Titoli principali | | |
|---|---|---|
| Nome | Settore | % |
| JPM USD Liquidity LVNAV X... | — | 9,50 |
| United States Treasury Bills... | — | 4,68 |
| United States Treasury Bills... | — | 2,83 |
| United States Treasury Bills... | — | 2,81 |
| BAR PORTFOLIO SWAP USD | — | 2,27 |
| PTC Inc 4% | — | 0,31 |
| SunCoke Energy, Inc. 4.875% | — | 0,30 |
| Moss Creek Resources... | — | 0,30 |
| Amerigas Partners,... | — | 0,30 |
| Alliance Resource Operating... | — | 0,30 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 23,60 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 340 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 132 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 24,19 |
| Societario | 47,18 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 27,94 |
| Derivati | 0,70 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 12,44 |
| Da 4 a 6 cedole | 29,74 |
| Da 6 a 8 cedole | 35,20 |
| Da 8 a 10 cedole | 18,78 |
| Da 10 a 12 cedole | 3,84 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

| Ripartizione Geografica % | Fondo |
|---|---|
| **America** | **76,97** |
| Stati Uniti | 71,27 |
| Canada | 5,70 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| **Europa** | **0,82** |
| Regno Unito | 0,00 |
| Europa Occidentale - Euro | 0,00 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,63 |
| Europa dell'Est | 0,00 |
| Africa | 0,00 |
| Medio Oriente | 0,19 |
| **Asia** | **22,21** |
| Giappone | 19,26 |
| Australasia | 2,28 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 0,00 |
| Asia - Emergente | 0,66 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l. |
| Telefono | +352 34 101 |
| Web | http://www.jpmorganassetmanagement.com |
| Patrimonio Classe (Mln) (09/11/2026) | 4,16 EUR |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU0875415845 |
| Investimento Min. Ingresso | 35.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | 5.000 EUR |
| T.E.R. | 1,55% |
| Spese correnti | 1,55% |
| Commissione di incentivo | - |

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

# JPMorgan Funds - Diversified Risk Fund A (acc) EUR (hedged)

| | |
|---|---|
| Data di Partenza | 11/04/2013 |
| Nome del Gestore | Yazann Romahi |
| Data Inizio Gestione | 08/02/2013 |
| NAV (11/11/2026) | EUR 86,90 |
| Patrimonio Netto (Mln) | 137,85 USD |
| (30/09/2026) | |

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