

# Natixis AM Funds - Natixis Conservative Risk Parity R/A (EUR)

## Categoria Morningstar™

Bilanciati Prudenti EUR - Globali

## Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

Euro Short Term Rate

## Morningstar Rating™

★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

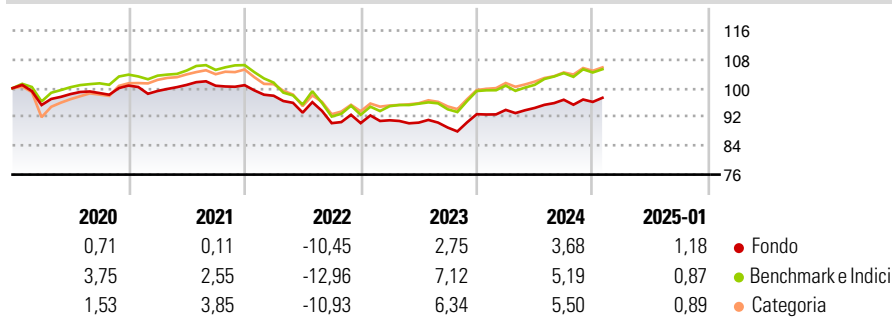
L'obiettivo d'investimento del Comparto consiste nel beneficiare dei cicli di mercato rialzisti limitando al contempo la sensibilità del portafoglio ai ribassi dei mercati nell'arco del periodo minimo di investimento consigliato di 3 anni. Sebbene non gestito rispetto a un indice di riferimento, il Comparto può essere comparato, esclusivamente a scopo indicativo, con l'indice composto per il 70% dal Citigroup WGBI All Maturities Local, rappresentativo del mercato dei titoli di stato globali, e per il 30% dall'MSCI AC World Daily Net TR, rappresentativo del mercato azionario globale, mercati emergenti compresi.

### Misure di Rischio

|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -1,29 | 3Y Sharpe Ratio | -0,52 |
| 3Y Beta           | 0,85  | 3Y Std Dev      | 5,66  |
| 3Y R-Squared      | 93,13 | 3Y Risk         | Med   |
| 3Y Info Ratio     | -0,55 | 5Y Risk         | -Med  |
| 3Y Tracking Error | 1,74  | 10Y Risk        | -Med  |

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

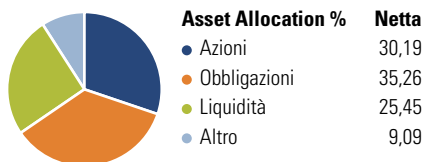
### Rendimenti



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk  | Cat  | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 2,05  | 2,13 | 2,44 | 2025                     | -     | -     | -     | -     |
| 6-Mesi           | 2,76  | 2,92 | 3,68 | 2024                     | 1,28  | 0,59  | 2,41  | -0,62 |
| 1-Anno           | 5,18  | 6,10 | 7,05 | 2023                     | 0,88  | -0,73 | -1,51 | 4,17  |
| 3-Anni Ann.ti    | -0,56 | 0,70 | 1,33 | 2022                     | -2,91 | -4,79 | -3,13 | 0,01  |
| 5-Anni Ann.ti    | -0,71 | 0,78 | 1,43 | 2021                     | -1,48 | 1,69  | -0,22 | 0,14  |
| 10-Anni Ann.ti   | 0,17  | 1,76 | 1,46 |                          |       |       |       |       |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

### Portafoglio 31/12/2024

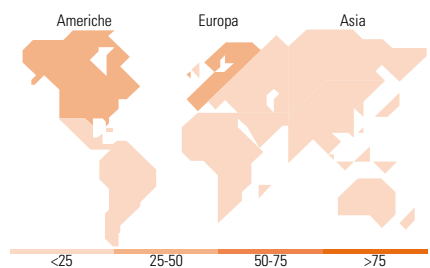


### Morningstar Style Box®

#### Stile Azionario



#### Reddito Fisso



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Ostrum SRI Money Plus SI                    | —       | 15,56 |
| Germany (Federal Republic...)               | —       | 12,74 |
| DNCA Invest Alpha Bonds SI EUR              | —       | 5,31  |
| Ostrum SRI Credit Ultr Shrt...              | —       | 4,63  |
| Italy (Republic Of) 3.6%                    | —       | 4,62  |
| Portugal (Republic Of) 2.875%               | —       | 4,58  |
| Spain (Kingdom of) 3.5%                     | —       | 3,86  |
| Natixis Global Multi...                     | —       | 3,67  |
| Amundi Euro HY Bd ESG - DR...               | —       | 3,20  |
| Amundi MSCI...                              | —       | 3,18  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 61,36 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 12    |

### Distribuzione Settoriale %

|           | Fondo |
|-----------|-------|
| Ciclico   | 46,87 |
| Sensibile | 37,29 |
| Difensivo | 15,83 |

### Fixed Income Sector Weightings %

|                          | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo              | 47,44 |
| Societario               | 11,16 |
| Cartolarizzazioni        | 0,01  |
| Enti Locali              | 0,00  |
| Liquidità ed equivalenti | 41,65 |
| Derivati                 | -0,26 |

### Ripartizione Geografica %

|                               | Fondo        |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>28,15</b> |
| Stati Uniti                   | 26,10        |
| Canada                        | 1,30         |
| America Latina e Centrale     | 0,75         |
| <b>Europa</b>                 | <b>38,02</b> |
| Regno Unito                   | 5,96         |
| Europa Occidentale - Euro     | 26,37        |
| Europa Occidentale - Non Euro | 2,94         |
| Europa dell'Est               | 0,23         |
| Africa                        | 1,81         |
| Medio Oriente                 | 0,72         |
| <b>Asia</b>                   | <b>33,83</b> |
| Giappone                      | 14,21        |
| Australasia                   | 4,41         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 8,15         |
| Asia - Emergente              | 7,07         |

### Anagrafica

|                      |   |                         |              |                              |       |
|----------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione  | Natixis Investment Managers International | Patrimonio Classe (Mln) | 46,05 EUR    | Investimento Min. Ingresso   | -     |
| Telefono             | +33 1 78408000                            | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -     |
| Web                  | www.im.natixis.com                        | Valuta del Fondo        | EUR          | T.E.R.                       | -     |
| Data di Partenza     | 25/06/2013                                | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 1,59% |
| Nome del Gestore     | Pierre Radot                              | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -     |
| Data Inizio Gestione | 10/08/2015                                | ISIN                    | LU0935227537 |                              |       |
| NAV (03/02/2025)     | EUR 114,79                                |                         |              |                              |       |

# Natixis AM Funds - Natixis Conservative Risk Parity R/A (EUR)

Patrimonio Netto (Mln) 55,06 EUR

(31/12/2024)