## **Fulcrum Multi Asset Trend Class C USD**

Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001012

**Benchmark Morningstar** 

Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD Usato nel Report

#### **Benchmark Dichiarato**

N/A

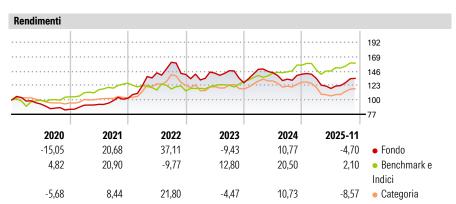
Morningstar Rating™

 $\star\star\star$ 

### **Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

The Sub-Fund seeks to generate long term capital appreciation in the value of its assets by gaining exposure to certain trends through the use of systematic trading strategies that seek to primarily invest in liquid assets. The Sub-Fund is a quantitative fund with investment decisions being based on price trends across markets. The Sub-Fund employs a number of quantitative models to analyse the momentum and volatility of assets in order to extract price forecasts and to determine positioning. The strategy seeks to establish a diversified portfolio of long and short positions exploiting trends in the currency, equity, commodity indices, and fixed income markets.

Misure di Rischio					
3Y Alpha	-0,54	3Y Sharpe Ratio	-0,27		
3Y Beta	-0,22	3Y Std Dev	14,37		
3Y R-Squared	3,69	3Y Risk	Med		
3Y Info Ratio	-0,79	5Y Risk	Med		
3Y Tracking Error	14,52	10Y Risk	Med		
Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)					



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	9,30	4,64	5,80	Trimestrali %				
6-Mesi	12,11	8,76	5,37	2025	-4,80	-11,94	7,71	-
1-Anno	-3,64	1,18	-4,36	2024	16,96	-3,71	-7,13	5,90
3-Anni Ann.ti	-0,30	10,00	-1,05	2023	-6,17	8,24	2,71	-13,17
5-Anni Ann.ti	10,51	8,75	6,38	2022	19,55	16,81	11,79	-12,18
10-Anni Ann.ti	2,43	8,01	2,20	2021	7,77	1,45	6,32	3,81
Rendimenti aggiornati al 05/12/2	2025							

### Portafoglio 30/09/2025

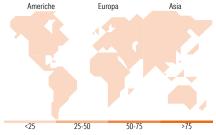




Fixed Income Sector Weightings %

	ronac
Duration Effettiva	
Maturity effettiva	
Qualità Credito Media	

Fondo



Titoli principali		
Nome	Settore	%
Short-Term Euro BTP Future	_	9,75
Japan (Government Of) 0%	_	7,85
Japan (Government Of) 0%	_	7,03
France (Republic Of) 0%	_	6,29
France (Republic Of) 0%	-	6,24
Future on S&P Canada 60 Index	-	6,23
France (Republic Of) 0%	_	5,63
France (Republic Of) 0%	_	5,30
Japan (Government Of) 0%	_	4,67
Japan (Government Of) 0%	=	4,66
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		63,66
Numero Complessivo di Titoli Azionari	i	9
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	47

₩ Governativo	143,85
Societario	0,01
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	-863,28
Derivati	819,41
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	Fulcrum Asset Management LLP	Patrimonio Classe (MIn) (05/12/2025)	40,09 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo	1.000.000 USD
Telefono	+44 20 70166450	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	www.fulcrumasset.com	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,02%
Data di Partenza	30/04/2015	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	31/07/2020	ISIN	LU1225880415		
NAV (05/12/2025)	USD 127,09				

# **Fulcrum Multi Asset Trend Class C USD**

Patrimonio Netto (MIn)

115,69 USD

(30/09/2025)

