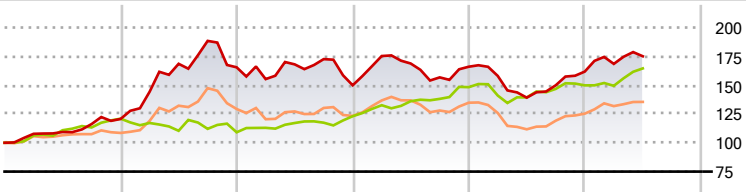
# Fulcrum Multi Asset Trend Class C USD

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Category_EUCA001012 | Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD<br>Usato nel Report | N/A | ★★★ |

## 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.

## Rendimenti




| 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-06 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 20,68 | 37,11 | -9,43 | 10,77 | -2,53 | 8,20 | Fondo |
| 20,90 | -9,77 | 12,80 | 20,50 | 1,05 | 9,82 | Benchmark e Indici |
| 8,44 | 21,80 | -4,47 | 10,73 | -6,78 | 8,12 | Categoria |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -3,38 | 3Y Sharpe Ratio | -0,05 |
| 3Y Beta | 0,26 | 3Y Std Dev | 13,33 |
| 3Y R-Squared | 4,18 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,84 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 12,80 | 10Y Risk | Med |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | 2,91 | 9,37 | 2,96 |
| 6-Mesi | 8,21 | 9,44 | 6,34 |
| 1-Anno | 26,03 | 17,88 | 15,34 |
| 3-Anni Ann.ti | 1,43 | 11,91 | 3,29 |
| 5-Anni Ann.ti | 9,81 | 8,01 | 6,65 |
| 10-Anni Ann.ti | 3,16 | 8,89 | 3,17 |

Rendimenti aggiornati al 02/07/2026

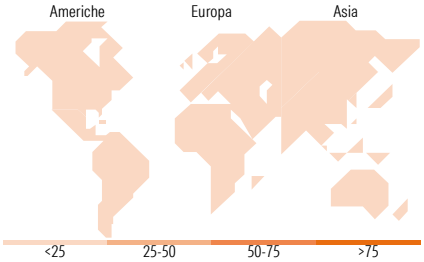
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 4,10 | 3,93 | - | - |
| 2025 | -4,80 | -11,94 | 7,71 | 7,93 |
| 2024 | 16,96 | -3,71 | -7,13 | 5,90 |
| 2023 | -6,17 | 8,24 | 2,71 | -13,17 |
| 2022 | 19,55 | 16,81 | 11,79 | -12,18 |

## Portafoglio 31/05/2026

| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 39,21 |
| Liquidità | 61,06 |
| Altro | -0,27 |

**Fixed Income Style Box™**

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




### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| France (Republic Of) 0% | — | 6,31 |
| Japan (Government Of) 0% | — | 6,11 |
| Japan (Government Of) 0% | — | 5,84 |
| France (Republic Of) 0% | — | 5,39 |
| France (Republic Of) 0% | — | 5,15 |
| France (Republic Of) 0% | — | 5,13 |
| France (Republic Of) 0% | — | 4,92 |
| France (Republic Of) 0% | — | 4,91 |
| France (Republic Of) 0% | — | 4,89 |
| Japan (Government Of) 0% | — | 4,63 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 53,27 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 44 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 82,71 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 16,61 |
| Derivati | 0,68 |

| 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 |
| Telefono | +44 20 70166450 |
| Web | www.fulcrumasset.com |
| Data di Partenza | 30/04/2015 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 30/04/2015 |
| NAV (02/07/2026) | USD 136,81 |
| Patrimonio Classe (Mln) (02/07/2026) | 27,50 USD |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | USD |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU1225880415 |
| Investimento Min. Ingresso | 1.000.000 USD |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | - |
| Spese correnti | 1,02% |
| 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.

# Fulcrum Multi Asset Trend Class C USD

| | |
|---|---|
| Patrimonio Netto (Mln) | 118,12 USD |
| (31/05/2026) | |

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.