# **Zest Asset Management Zest Derivatives Allocation Fund R1 Cap**

Categoria Morningstar™

Alt - Global Macro

## Benchmark Morningstar

Usato nel Report

Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR

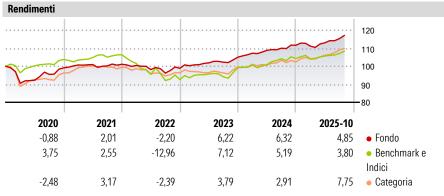
## **Benchmark Dichiarato**

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

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

The Sub-Fund aims to seek a consistent, absolute return while placing emphasis on the preservation of capital in the medium to long term. The use of financial derivative instruments will be mostly used to reduce the risk. The Investment Manager goal is to smooth volatility through options strategies for yield enhancing.



Misure di Rischio					
3Y Alpha	2,02	3Y Sharpe Ratio	1,12		
3Y Beta	0,50	3Y Std Dev	2,80		
3Y R-Squared	66,21	3Y Risk	-Med		
3Y Info Ratio	0,36	5Y Risk	-Med		
3Y Tracking Error	2,81	10Y Risk	Med		
Basati su Morningstar Euro applicabile)	Cautious	Global Target Allocation N	R EUR (dove		

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,87	1,69	2,95	Trimestrali %				
6-Mesi	5,50	3,52	5,44	2025	-0,47	1,69	2,06	-
1-Anno	6,34	4,32	8,00	2024	2,10	1,48	1,10	1,49
3-Anni Ann.ti	6,30	5,34	4,16	2023	1,93	1,07	0,40	2,70
5-Anni Ann.ti	3,80	1,12	1,95	2022	-0,66	-2,26	-2,01	2,78
10-Anni Ann.ti	2,39	1,96	1,58	2021	1,62	0,23	-0,73	0,89
Rendimenti aggiornati al 05/11/2	2025							

#### Portafoglio 31/10/2025





Fondo **Duration Effettiva** Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome Setto	re	%
United States Treasury Notes	_	6,45
VanEck Semiconductor ETF	_	5,08
iShares Edge MSCI Eurp Val	_	3,00
France (Republic Of) 0.25%	_	2,66
Banca IFIS S.p.A 7.38%	_	2,58
Intesa Sanpaolo S.p.A. 6.184%	_	2,30
TBI ITALY 141026 SR S	_	1,77
Italy (Republic Of) 0.45%	_	1,70
Intesa Sanpaolo S.p.A. 4.375%	_	1,56
Italy (Republic Of) 2.603%	_	1,51
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		28,61
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1
NumeroComplessivodiTitoliObbligazion ari		53

(31/10/2025)

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
₩ Governativo	45,44
Societario	25,62
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	28,94
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	26,19
Da 0 a 4 cedole	54,65
Da 4 a 6 cedole	8,29
Da 6 a 8 cedole	10,88
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	45,62
Stati Uniti	45,62
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	48,14
Regno Unito	8,07
Europa Occidentale - Euro	36,30
Europa Occidentale - Non Euro	3,77
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	6,24
Giappone	0,04
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	6,05
Asia - Emergente	0,13

Anagrafica					
Società di Gestione	LFG+ZEST SA	Patrimonio Classe (MIn)	32,78 EUR	Investimento Min. Ingresso	1.000 EUR
Telefono	=	(05/11/2025)		Investimento Min. Successivo	1.000 EUR
Web	=	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,76%
Data di Partenza	02/06/2015	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,68%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	02/06/2015	Inc/Acc	Acc		
NAV (05/11/2025)	EUR 1.273,36	ISIN	LU1216085701		
Patrimonio Netto (MIn)	33,23 EUR				