

BCV Fund (Lux) - BCV Liquid Alternative Beta B (EUR)

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

HFRX Global Hedge Fund USD

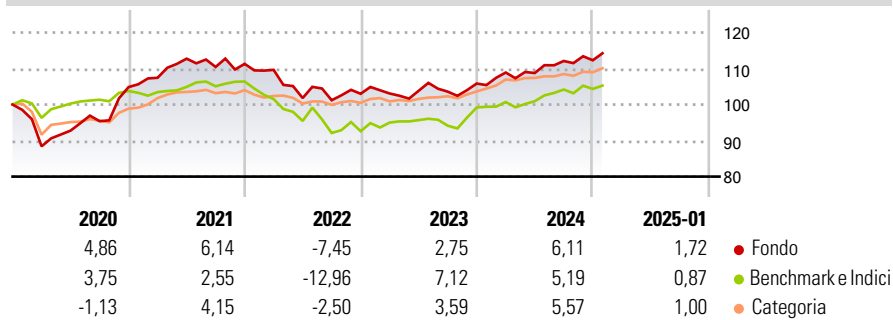
Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of the sub-fund is to replicate the risk/return profile of an investment in a diversified portfolio of hedge funds. To achieve this, the managers apply a quantitative factorial regression management method.

Rendimenti



Misure di Rischio

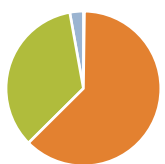
| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | 0,54 | 3Y Sharpe Ratio | -0,13 |
| 3Y Beta | 0,70 | 3Y Std Dev | 5,73 |
| 3Y R-Squared | 61,14 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | 0,29 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 3,99 | 10Y Risk | +Med |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|-------|-------|------|
| 3-Mesi | 2,21 | 2,13 | 2,07 | 2025 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 4,78 | 2,92 | 2,82 | 2025 | - | - | - | - |
| 1-Anno | 7,94 | 6,10 | 5,95 | 2024 | 2,90 | -0,13 | 3,07 | 0,18 |
| 3-Anni Ann.ti | 1,49 | 0,70 | 2,84 | 2023 | 0,07 | 0,73 | -0,23 | 2,16 |
| 5-Anni Ann.ti | 2,90 | 0,78 | 2,51 | 2022 | -1,49 | -7,14 | -0,60 | 1,78 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,65 | 1,76 | 1,54 | 2021 | 2,47 | 4,93 | -2,03 | 0,76 |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Portafoglio 31/01/2025



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| Azioni | -0,23 |
| Obbligazioni | 66,41 |
| Liquidità | 36,85 |
| Altro | -3,03 |

Fixed Income

Style Box™

| | | Qualità Credito | | |
|----------------------|-------|-----------------|-----|-------|
| | | Alto | Med | Basso |
| Sensibilità ai Tassi | Bassa | | | |
| | Med | | | |
| | Alta | | | |

Fondo
Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---------------------------------------------|---------|-------|
| United States Treasury Bills... | - | 18,64 |
| United States Treasury Bills... | - | 14,14 |
| United States Treasury Bills... | - | 13,47 |
| United States Treasury Bills... | - | 12,38 |
| United States Treasury Bills... | - | 11,24 |
| United States Treasury Bills... | - | 10,79 |
| United States Treasury Bills... | - | 9,19 |
| Euro Stoxx 50 EUR (Price)... | - | 0,27 |
| Swp Sgcoco 310125 | - | 0,19 |
| Nikkei 225 Index Fut 03/25 Ose | - | 0,04 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 90,35 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 9 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Gov | 86,71 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 12,46 |
| Derivati | 0,83 |

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 Sviluppatti | - |
| Asia - Emergente | - |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione | Banque Cantonale Vaudoise | Patrimonio Classe (Mln) | 9,90 EUR | Investimento Min. Ingresso | 5.000.000 EUR |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | 5.000.000 EUR |
| Web | - | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | 0,83% |
| Data di Partenza | 16/05/2014 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,94% |
| Nome del Gestore | Philippe Pillonel | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 16/05/2014 | ISIN | LU1035012613 | | |
| NAV (03/02/2025) | EUR 118,99 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 236,69 USD | | | | |

(31/01/2025)