

# Fulcrum UCITS SICAV - Fulcrum Diversified Absolute Return Fund I GBP Acc

## Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001006

## Benchmark Morningstar

Morningstar UK Cautious Target Allocation N/A

NR GBP

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

N/A

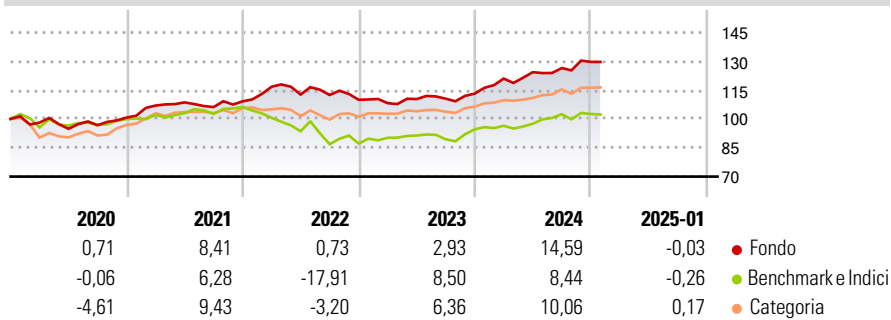
## Morningstar Rating™

★★★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund seeks to achieve long-term absolute returns of 3% to 5% over the SOFR interest rate in all market conditions over rolling five year annualised periods, with lower volatility than equity markets. In doing so the Sub-Fund aims to achieve a positive return on a rolling three year basis. However, a positive return is not guaranteed and a capital loss may occur.

### Rendimenti



### Misure di Rischio

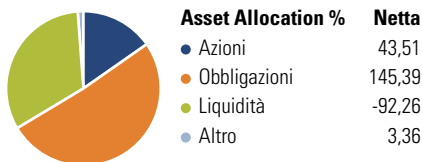
3Y Alpha	2,22	3Y Sharpe Ratio	0,50
3Y Beta	0,09	3Y Std Dev	6,74
3Y R-Squared	1,23	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,83	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	7,57	10Y Risk	-

Basati su Morningstar UK Cautious Target Allocation NR GBP (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,70	2,59	3,20	2025	-	-	-	-
6-Mesi	7,15	3,90	6,52	2025	-	-	-	-
1-Anno	12,05	7,77	9,93	2024	6,91	2,75	1,72	2,54
3-Anni Ann.ti	5,35	0,19	4,03	2023	-1,60	1,98	0,18	2,40
5-Anni Ann.ti	5,34	0,24	3,90	2022	6,97	-3,49	-0,22	-2,21
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	6,22	1,54	-2,25	2,83

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Portafoglio 30/09/2024



### Fixed Income

#### Style Box™

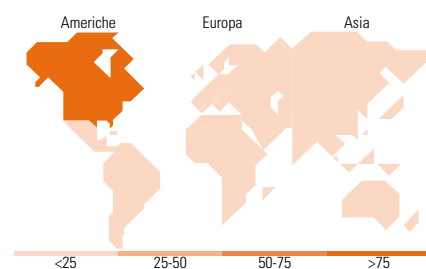
		Qualità Credito		
		Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa			
	Med			
	Alta			

Duration Effettiva -

Maturità effettiva -

Qualità Credito Media

### Fondo



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Euro Bund Future Dec 24	-	18,29
Euro Schatz Future Dec 24	-	17,73
Put On E-mini S&P 500...	-	13,56
2 Year Treasury Note Future...	-	11,44
E-mini S&P 500 Future Dec 24	-	10,16
Future on TOPIX	-	5,81
Japan (Government Of) 0%	-	5,63
France (Republic Of) 0%	-	5,53
Hang Seng Index Future Oct 24	-	5,43
Euro Bobl Future Dec 24	-	5,10
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		98,68
Numero Complessivo di Titoli Azionari		358
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		82

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	3.941,57
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-15.195,41
Derivati	11.353,84

### Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	0,00
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
<b>America</b>	<b>81,73</b>
Stati Uniti	79,46
Canada	2,26
America Latina e Centrale	0,01
<b>Europa</b>	<b>16,84</b>
Regno Unito	4,51
Europa Occidentale - Euro	9,53
Europa Occidentale - Non Euro	2,12
Europa dell'Est	0,02
Africa	0,66
Medio Oriente	0,00
<b>Asia</b>	<b>1,44</b>
Giappone	1,00
Australasia	0,30
Asia - Paesi Sviluppatti	0,12
Asia - Emergente	0,02

### Anagrafica

Società di Gestione	Fulcrum Asset Management LLP	Patrimonio Classe (Mln)	17,29 GBP	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+44 20 70166450	(04/02/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.fulcrumasset.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	01/02/2017	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti	0,94%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/02/2017	Inc/Acc	Acc		
NAV (04/02/2025)	GBP 129,95	ISIN	LU1551069211		
Patrimonio Netto (Mln)	722,10 USD				

(30/09/2024)