

Systematica UCITS Fund ICAV - Systematica Alternative Risk Premia Fund (SARP)

Categoria Morningstar™

UCITS) class C USD NB

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

Senza rating

Allocation NR USD

Usato nel Report

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

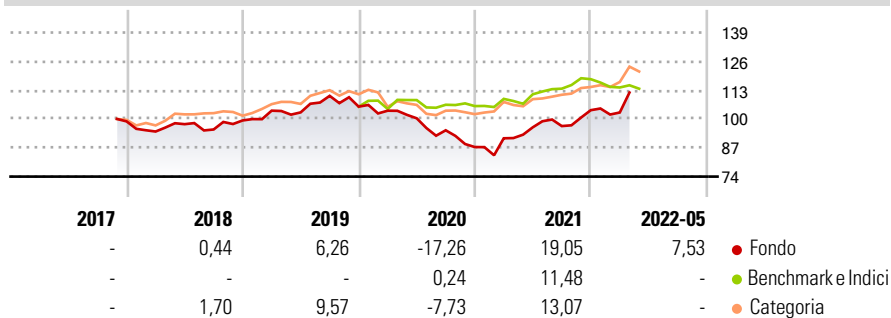
The primary objective of the Fund is to seek to achieve long-term appreciation in the value of its assets. The Fund seeks to achieve its investment objective by investing globally in a diversified portfolio of equities, U.S. treasuries and the FDIs listed in the table below, including those giving exposure to equities and U.S. treasuries. The equities and U.S. treasuries in which the Fund invests are listed or traded on Recognised Markets. The Fund may invest in currencies and the FDIs listed in the FDI table below for both hedging and investment purposes. In order to enable the Fund to meet its daily funding requirements, the Fund may also invest in cash and cash equivalents (including treasury bills, bank deposits, deposit certificates...

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | 1,09 | 3Y Sharpe Ratio | 0,38 |
| 3Y Beta | 0,16 | 3Y Std Dev | 11,39 |
| 3Y R-Squared | 1,27 | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | -0,13 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 9,57 | 10Y Risk | - |

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

| | Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 12,01 | 6,68 | 7,55 |
| 6-Mesi | 12,17 | 8,29 | 9,28 |
| 1-Anno | 22,41 | 12,02 | 12,14 |
| 3-Anni Ann.ti | 3,46 | 5,64 | 8,94 |
| 5-Anni Ann.ti | - | 4,17 | 6,47 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 17/05/2022

Rendimenti

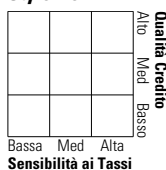
| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|------|------|------|
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | - | - | - | - |
| 2023 | - | - | - | - |
| 2022 | -1,01 | - | - | - |
| 2021 | 4,52 | 5,41 | 0,59 | 7,42 |

Portafoglio -

Asset Allocation % Netta

Fixed Income

Style Box™

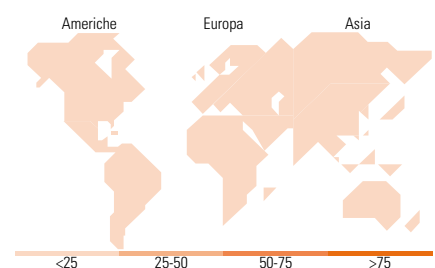


Duration Effettiva -

Maturità effettiva -

Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|------|
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 0,00 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | - |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | - |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 0,00 |
| Derivati | 0,00 |

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 |
|-------------------------------|-------------|
| 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 | Systematica Investments Limited | Patrimonio Classe (Mln) | 0,68 USD | Investimento Min. Ingresso | 200.000.000 USD |
| Telefono | 44 (0)15 3484 1090 | Domicilio | IRLANDA | Investimento Min. Successivo | 10.000 USD |
| Web | www.systematica.com | Valuta del Fondo | USD | T.E.R. | 0,23% |
| Data di Partenza | 08/11/2017 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,90% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 08/11/2017 | ISIN | IE00BD9PX856 | | |

Systematica UCITS Fund ICAV - Systematica Alternative Risk Premia Fund (SARP

NAV (17/05/2022) USD 98,33
UCITS) Class C USD ND -
