

Fulcrum UCITS SICAV - Fulcrum Diversified Absolute Return Fund I USD Inc

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001007

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

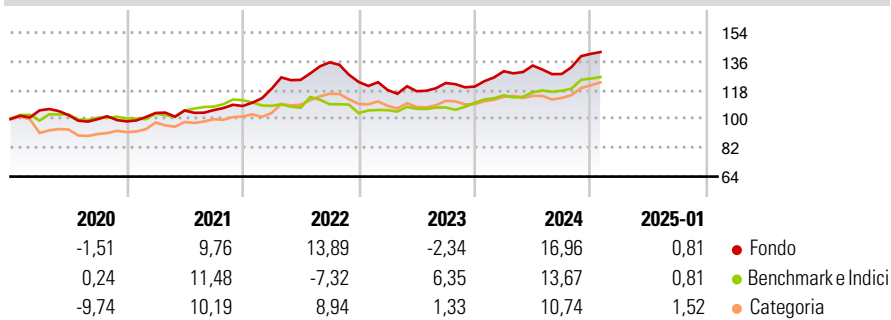
Morningstar Rating™

★★★★

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

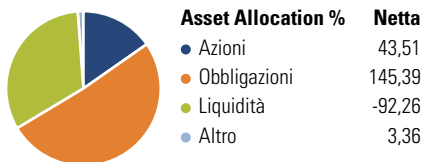
3Y Alpha	1,94	3Y Sharpe Ratio	0,69
3Y Beta	0,10	3Y Std Dev	9,37
3Y R-Squared	2,69	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,46	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	8,80	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,77	5,33	6,89	2025	-	-	-	-
6-Mesi	13,14	9,97	10,52	2024	7,94	2,77	-3,97	9,80
1-Anno	15,25	12,19	11,33	2023	-4,11	-0,62	4,35	-1,80
3-Anni Ann.ti	9,16	5,81	7,63	2022	9,99	4,66	8,76	-9,03
5-Anni Ann.ti	6,86	4,06	4,92	2021	5,32	1,48	0,24	2,45
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 10/02/2025

Portafoglio 30/09/2024



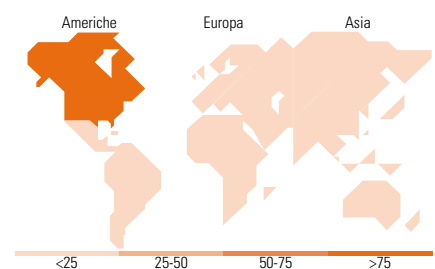
Fixed Income

Style Box™



Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-



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 %

Settore	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 %

Categoria	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 %

Regione	Fondo
America	81,73
Stati Uniti	79,46
Canada	2,26
America Latina e Centrale	0,01
Europa	16,84
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
Asia	1,44
Giappone	1,00
Australasia	0,30
Asia - Paesi Sviluppati	0,12
Asia - Emergente	0,02

Anagrafica

Società di Gestione	Fulcrum Asset Management LLP	Patrimonio Classe (Mln)	2,21 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+44 20 70166450	(10/02/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.fulcrumasset.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	13/04/2018	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,94%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/02/2017	Inc/Acc	Inc		
NAV (10/02/2025)	USD 131,86	ISIN	LU1561566479		
Patrimonio Netto (Mln)	722,10 USD				

(30/09/2024)