

BCV Fund (Lux) - BCV Liquid Alternative Beta D (USD)

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

HFRX Global Hedge Fund USD

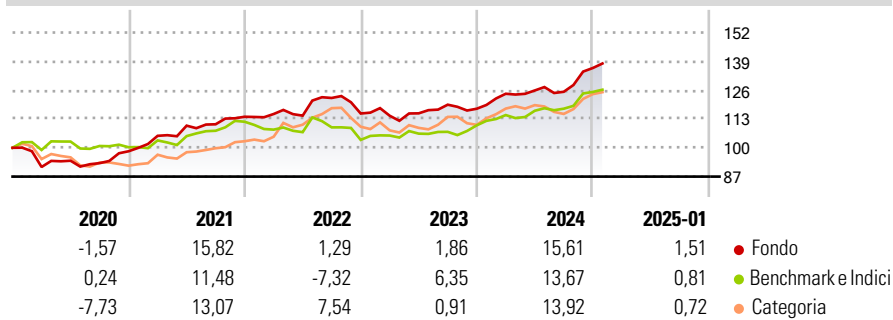
Morningstar Rating™

★★★★

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

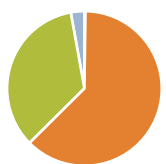
| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 0,89 | 3Y Sharpe Ratio | 0,62 |
| 3Y Beta | 0,57 | 3Y Std Dev | 6,92 |
| 3Y R-Squared | 66,30 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | 0,41 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 4,78 | 10Y Risk | - |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 8,10 | 6,68 | 7,55 | 2025 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 12,15 | 8,29 | 9,28 | 2024 | 5,75 | 1,19 | -0,47 | 8,55 |
| 1-Anno | 15,47 | 12,02 | 12,14 | 2023 | -0,87 | 0,94 | 3,38 | -1,52 |
| 3-Anni Ann.ti | 7,61 | 5,64 | 8,94 | 2022 | 1,08 | -0,63 | 6,96 | -5,72 |
| 5-Anni Ann.ti | 6,66 | 4,17 | 6,47 | 2021 | 7,07 | 4,35 | 0,57 | 3,06 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Portafoglio 31/01/2025



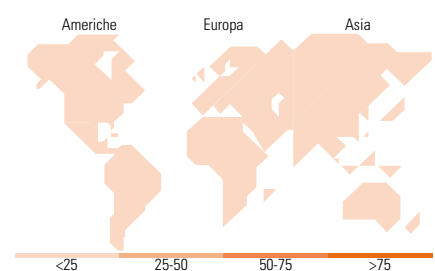
| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| Azioni | -0,23 |
| Obbligazioni | 66,41 |
| Liquidità | 36,85 |
| Altro | -3,03 |

Fixed Income

Style Box™

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

| Fondo | |
|-----------------------|---|
| Duration Effettiva | - |
| Maturità effettiva | - |
| Qualità Credito Media | - |



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 | |
|--------------------------|-------|
| Governativo | 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 Sviluppati | - |
| Asia - Emergente | - |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|----------------|
| Società di Gestione | Banque Cantonale Vaudoise | Patrimonio Classe (Mln) | 15,04 USD | Investimento Min. Ingresso | 50.000.000 USD |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | 50.000.000 USD |
| Web | - | Valuta del Fondo | USD | T.E.R. | 0,51% |
| Data di Partenza | 18/04/2018 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,62% |
| Nome del Gestore | Philippe Pillonel | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 16/05/2014 | ISIN | LU1809249144 | | |
| NAV (03/02/2025) | USD 149,27 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 236,69 USD | | | | |

(31/01/2025)