

GMO Global Real Return UCITS Fund E EUR

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

OECD G7 Consumer Price

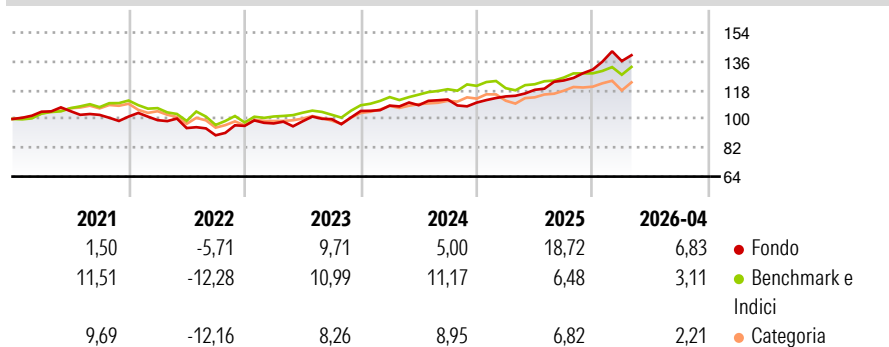
Morningstar Rating™

★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of the Fund is to seek to achieve a return in excess of its Benchmark through investment globally in equities, debt, money market instruments, currencies, instruments relating to commodities indices, REITS and related derivatives.

Rendimenti



Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 5,00 | 3Y Sharpe Ratio | 1,18 |
| 3Y Beta | 0,69 | 3Y Std Dev | 7,70 |
| 3Y R-Squared | 31,87 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | 0,50 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 6,69 | 10Y Risk | - |

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

Rend. Cumulati %

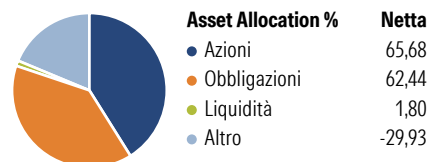
| | Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 1,42 | 2,12 | 1,96 |
| 6-Mesi | 12,08 | 3,58 | 5,35 |
| 1-Anno | 24,15 | 10,51 | 14,30 |
| 3-Anni Ann.ti | 13,75 | 9,28 | 9,02 |
| 5-Anni Ann.ti | 6,04 | 5,26 | 4,51 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

Rendimenti

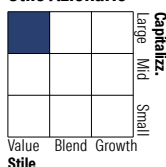
| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | 4,05 | - | - | - |
| 2025 | 3,49 | 3,59 | 4,95 | 5,52 |
| 2024 | 3,19 | 0,23 | 3,27 | -1,69 |
| 2023 | 1,57 | 1,39 | 1,37 | 5,10 |
| 2022 | -2,22 | -4,98 | -4,77 | 6,57 |

Portafoglio 31/03/2026

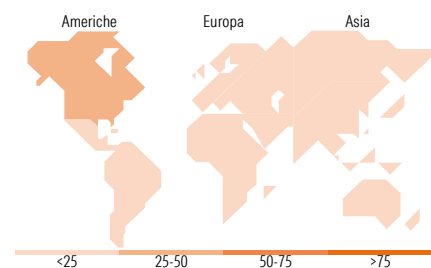


Morningstar Style Box®

Stile Azionario



Reddito Fisso



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Contra Derivatives - Swaps | - | 16,69 |
| United States Treasury Notes... | - | 13,60 |
| 5 Year Treasury Note Future... | - | 12,34 |
| 10 Year Treasury Note Future... | - | 7,02 |
| 2 Year Treasury Note Future... | - | 5,79 |
| United States Treasury Notes... | - | 5,37 |
| Ultra 10 Year US Treasury... | - | 4,99 |
| United States Treasury Notes... | - | 4,94 |
| E-mini S&P 500 Future June 26 | - | 1,68 |
| Taiwan Semiconductor... | ☑ | 1,39 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 73,81 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 1.025 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 92 |

Distribuzione Settoriale %

| | Fondo |
|--------------|-------|
| 🔄 Ciclico | 40,10 |
| 📈 Sensibile | 43,59 |
| 🛡️ Difensivo | 16,31 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|----------------------------|--------|
| 🏛️ Governativo | 133,62 |
| ⚙️ Societario | 0,06 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 2,24 |
| 🏢 Enti Locali | 0,00 |
| 📄 Liquidità ed equivalenti | 2,81 |
| 📁 Derivati | -38,73 |

Ripartizione Geografica %

| | Fondo |
|-------------------------------|--------------|
| America | 37,36 |
| Stati Uniti | 29,95 |
| Canada | 5,36 |
| America Latina e Centrale | 2,05 |
| Europa | 24,85 |
| Regno Unito | 4,62 |
| Europa Occidentale - Euro | 13,11 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 4,94 |
| Europa dell'Est | 0,85 |
| Africa | 0,05 |
| Medio Oriente | 1,26 |
| Asia | 37,79 |
| Giappone | 20,65 |
| Australasia | 2,25 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 9,37 |
| Asia - Emergente | 5,52 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|------------|-------------------------|-------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione | GMO | Patrimonio Classe (Mln) | 1,52 EUR | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | (12/05/2026) | - | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | - | Domicilio | IRLANDA | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 04/12/2020 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,99% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 30/06/2019 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (12/05/2026) | EUR 28,58 | ISIN | IE00BFZM202 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 684,54 USD | | | | |

(31/03/2026)