

# PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund H Institutional USD

Categoria Morningstar™  
**Accumulation**

Benchmark Morningstar  
Morningstar US Moderate Target  
Allocation NR USD  
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato  
ICE BofA SOFR Overnight Rate TR USD

Morningstar Rating™  
★★

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

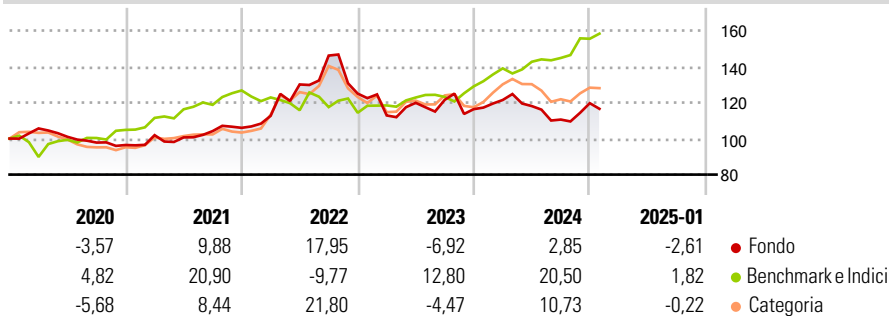
The Fund seeks positive, risk-adjusted returns, consistent with prudent investment management. The investment strategy for the Fund involves looking for price trends across global liquid futures and other derivative markets (such as foreign exchange forwards markets and interest rate swap markets and as further outlined below). The Fund attempts to profit from the price trends of securities (which are further outlined below) and derivatives (i.e. price movements of derivatives and securities which move either up and/or down) observed by the Investment Advisor in global financial markets and commodities (including agriculture, livestock, energy and metals).

## Misure di Rischio

3Y Alpha	-2,03	3Y Sharpe Ratio	0,12
3Y Beta	-0,54	3Y Std Dev	16,79
3Y R-Squared	29,26	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,27	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	20,87	10Y Risk	-

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

## Rendimenti

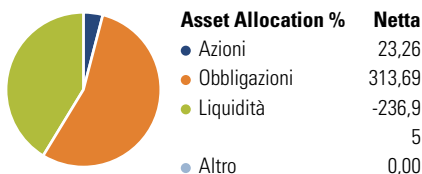


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	6,51	8,45	8,10
6-Mesi	1,34	12,88	7,48
1-Anno	-2,26	18,41	7,21
3-Anni Ann.ti	3,25	9,58	8,60
5-Anni Ann.ti	2,81	8,95	5,64
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

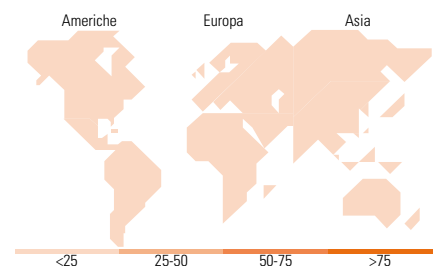
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	4,38	-2,77	-6,37	8,24
2023	-9,72	6,21	1,39	-4,25
2022	6,28	15,47	12,35	-14,46
2021	5,67	-1,24	3,49	1,74

## Portafoglio 30/09/2024



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	8,91
Maturity effettiva	10,02
Qualità Credito Media	BBB

Qualità Credito: Alto, Med, Basso  
Sensibilità ai Tassi: Bassa, Med, Alta



## Titoli principali

Nome	Settore	%
PIMCO USD Short Mat ETF	—	9,97
Government National Mortgage...	—	9,06
Greenleaves Capital DAC 0%	—	8,00
Aries Capital Designated...	—	8,00
3 Year Australian Treasury...	—	7,96
Federal National Mortgage...	—	4,74
Short-Term Euro BTP Future...	—	4,13
Federal National Mortgage...	—	3,83
10 Year Australian Treasury...	—	3,76
Federal National Mortgage...	—	2,97
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		62,43
Numero Complessivo di Titoli Azionari		3
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		775

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
🏛️ Governativo	286,16
⚙️ Societario	80,20
🏠 Cartolarizzazioni	34,05
🏢 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	-310,40
📁 Derivati	9,97

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>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppatti	-
Asia - Emergente	-

## Anagrafica

Società di Gestione	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited	Patrimonio Classe (Mln)	1,41 USD	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 USD
Telefono	+353 1 4752211	Domicilio	IRLANDA	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.pimco.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	1,57%
Data di Partenza	23/08/2022	UCITS	Si	Spese correnti	1,57%
Nome del Gestore	Matthew Dorsten	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/06/2015	ISIN	IE000TIW3CX2		
NAV (04/02/2025)	USD 9,13				

# PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund H Institutional USD

Patrimonio Netto (Mln)

171,82 USD

**Accumulation**

---