

# iMGP DBi Managed Futures I M USD

## Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001012

## Benchmark Morningstar

Morningstar US Moderate Target  
Allocation NR USD  
Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

SG CTA PR USD

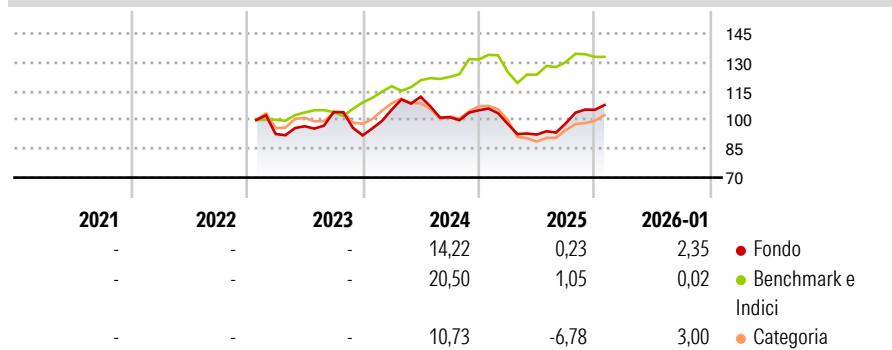
## Morningstar Rating™

★★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of this Sub-fund is to provide its investors with long-term capital appreciation by implementing a UCITS compliant strategy that seeks to approximate the returns that alternative funds using "managed futures style" (the "Managed Futures Alternative Funds") would typically achieve. The Fund seeks to achieve its objective by: (i) investing its assets in financial derivative instruments pursuant to a managed futures strategy; (ii) allocating up to 20% of its total assets in structured financial products ("SFI") to gain exposure to certain commodities; and (iii) investing directly in selected debt instruments for cash management and other purposes.

### Rendimenti



### Misure di Rischio

3Y Alpha	2,39	3Y Sharpe Ratio	0,03
3Y Beta	-0,15	3Y Std Dev	13,81
3Y R-Squared	1,34	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,55	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	13,84	10Y Risk	-

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

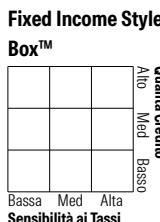
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	8,81	-1,08	2,89	2026	-	-	-	-
6-Mesi	21,76	4,22	10,35	2025	-6,75	-5,67	6,34	7,16
1-Anno	5,71	-1,04	-4,10	2024	14,56	6,38	-9,51	3,57
3-Anni Ann.ti	3,85	9,44	0,59	2023	-	4,35	7,67	-11,69
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-	Rendimenti aggiornati al 11/02/2026	-	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

### Portafoglio 31/03/2025

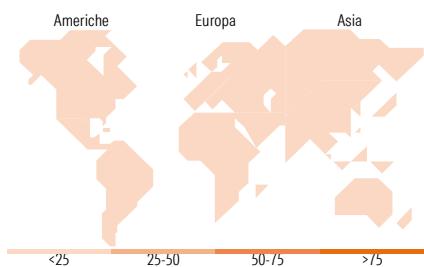


Asset Allocation %	Netta
• Azioni	14,55
• Obbligazioni	38,93
• Liquidità	46,52
• Altro	0,00



Duration Effettiva  
Maturity effettiva  
Qualità Credito Media

### Fondo



### Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	-	17,93
United States Treasury Bills...	-	13,44
United States Treasury Bills...	-	12,01
NYL MINI MSCI 0625	-	9,85
United States Treasury Bills...	-	9,80
United States Treasury Bills...	-	9,79
NYL MINI MSCI 0625	-	9,61
United States Treasury Bills...	-	7,46
United States Treasury Bills...	-	7,18
United States Treasury Bills...	-	4,04
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		101,10
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		5

### Fixed Income Sector Weightings %

Fondo
Governativo
Societario
Cartolarizzazioni
Enti Locali
Liquidità ed equivalenti
Derivati

### Coupon Range %

Fondo
0 coupon
Da 0 a 4 cedole
Da 4 a 6 cedole
Da 6 a 8 cedole
Da 8 a 10 cedole
Da 10 a 12 cedole
Oltre 12 cedole

### Ripartizione Geografica %

Fondo
America
Stati Uniti
Canada
America Latina e Centrale
Europa
Regno Unito
Europa Occidentale - Euro
Europa Occidentale - Non Euro
Europa dell'Est
Africa
Medio Oriente
Asia
Giappone
Australasia
Asia - Paesi Sviluppati
Asia - Emergenti

### Anagrafica

Società di Gestione	iM Global Partner Asset Management S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	14,94 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000.000 USD
Telefono	+352 26 27 36 1	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	<a href="https://www.imgp.com/">https://www.imgp.com/</a>	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	25/01/2023	UCITS	Si	Spese correnti	0,75%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	02/01/2023	ISIN	LU2550556745		
NAV (11/02/2026)	USD 1.238,12				

# iMGP DBi Managed Futures I M USD

Patrimonio Netto (Mln)

220,33 USD

(31/03/2025)