

# 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™**

★★★

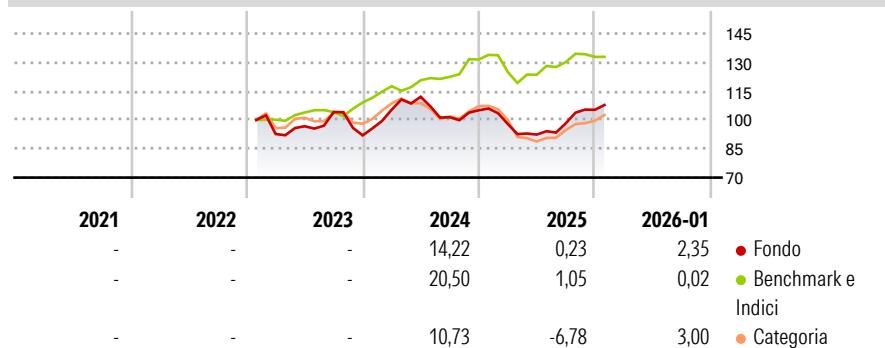
**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

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.

**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)

**Rendimenti**


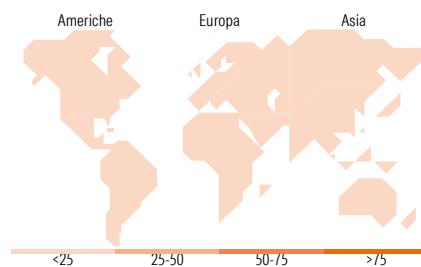
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	8,81	-1,08	2,89	2026	-	-	-	-
6-Mesi	21,76	4,22	10,35	2025	-6,75	-5,67	6,34	7,16
1-Anno	5,71	-1,04	-4,10	2024	14,56	6,38	-9,51	3,57
3-Anni Ann.ti	3,85	9,44	0,59	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	4,35	7,67	-11,69	-
10-Anni Ann.ti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

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

Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	-
Alta Med Bassa	Sensibilità ai Tassi


**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	95,54
Societario	8,58
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-4,49
Derivati	0,37
<b>Coupon Range %</b>	<b>Fondo</b>
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
<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 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)