

# Morgan Stanley Investment Funds - Global Macro Fund I

## Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001007

## Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

ICE BofA 0-3 M US Trsy Bill TR USD

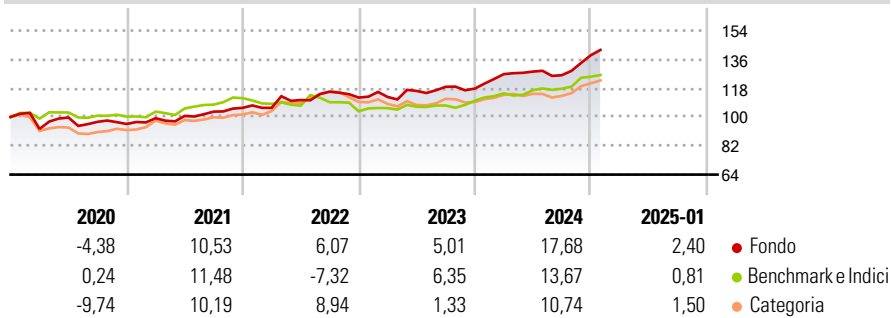
## Morningstar Rating™

★★★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Fund's investment objective is to increase the value of your investment, while seeking to achieve a positive return in any market conditions (absolute return) over any given 3-year period.

### Rendimenti



### Misure di Rischio

|                   |      |                 |       |
|-------------------|------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | 3,02 | 3Y Sharpe Ratio | 0,95  |
| 3Y Beta           | 0,18 | 3Y Std Dev      | 7,70  |
| 3Y R-Squared      | 9,22 | 3Y Risk         | Basso |
| 3Y Info Ratio     | 0,63 | 5Y Risk         | Med   |
| 3Y Tracking Error | 8,03 | 10Y Risk        | Med   |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1   | Q2   | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|------|------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 11,03 | 6,68  | 7,48  | 2025                     | -    | -    | -     | -     |
| 6-Mesi           | 11,93 | 8,29  | 9,30  | 2025                     | -    | -    | -     | -     |
| 1-Anno           | 16,44 | 12,02 | 11,07 | 2024                     | 7,67 | 1,24 | -1,74 | 9,88  |
| 3-Anni Ann.ti    | 10,47 | 5,64  | 7,16  | 2023                     | 0,33 | 3,38 | 2,23  | -0,96 |
| 5-Anni Ann.ti    | 6,75  | 4,17  | 4,87  | 2022                     | 0,03 | 4,61 | 4,69  | -3,19 |
| 10-Anni Ann.ti   | 5,06  | 4,81  | 4,73  | 2021                     | 3,78 | 1,43 | 2,64  | 2,30  |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Portafoglio 30/09/2024



### Fixed Income

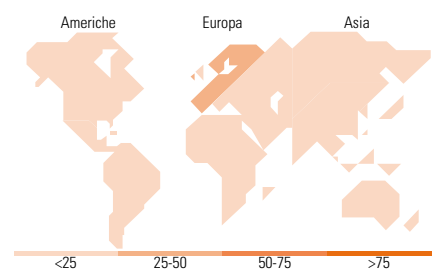
#### Style Box™



Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva -  
Maturità effettiva -  
Qualità Credito Media

### Fondo



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Cameroon (Republic of)                      | -       | 3,64  |
| Serbia (Republic Of)                        | -       | 3,15  |
| United States Treasury Bills                | -       | 2,67  |
| United States Treasury Bills                | -       | 2,66  |
| Ministerio de Hacienda y...                 | -       | 2,63  |
| Dominican Republic                          | -       | 2,00  |
| Ethiopia (Federal Democratic...             | -       | 1,89  |
| Ecuador (Republic Of)                       | -       | 1,89  |
| Serbia (Republic Of)                        | -       | 1,84  |
| Cameroon (Republic of)                      | -       | 1,77  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 24,14 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 96    |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 159   |

### Fixed Income Sector Weightings %

|                          | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo              | 70,32 |
| Societario               | 4,29  |
| Cartolarizzazioni        | 3,50  |
| Enti Locali              | 0,00  |
| Liquidità ed equivalenti | 21,94 |
| Derivati                 | -0,05 |

### Coupon Range %

|                   | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 6,79  |
| Da 0 a 4 cedole   | 7,59  |
| Da 4 a 6 cedole   | 15,82 |
| Da 6 a 8 cedole   | 29,55 |
| Da 8 a 10 cedole  | 25,55 |
| Da 10 a 12 cedole | 3,95  |
| Oltre 12 cedole   | 10,74 |

### Ripartizione Geografica %

|                               | Fondo        |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>5,53</b>  |
| Stati Uniti                   | 0,00         |
| Canada                        | 0,00         |
| America Latina e Centrale     | 5,53         |
| <b>Europa</b>                 | <b>74,78</b> |
| Regno Unito                   | 14,09        |
| Europa Occidentale - Euro     | 38,66        |
| Europa Occidentale - Non Euro | 3,47         |
| Europa dell'Est               | 18,55        |
| Africa                        | 0,00         |
| Medio Oriente                 | 0,00         |
| <b>Asia</b>                   | <b>19,70</b> |
| Giappone                      | 0,00         |
| Australasia                   | 0,00         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 0,00         |
| Asia - Emergente              | 19,70        |

### Anagrafica

|                        |  |                         |              |                              |       |
|------------------------|--|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione    | MSIM Fund Management (Ireland) Limited | Patrimonio Classe (Mln) | 13,87 USD    | Investimento Min. Ingresso   | -     |
| Telefono               | -                                      | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -     |
| Web                    | www.morganstanley.com/im               | Valuta del Fondo        | USD          | T.E.R.                       | 0,99% |
| Data di Partenza       | 11/08/2023                             | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 0,99% |
| Nome del Gestore       | -                                      | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -     |
| Data Inizio Gestione   | 08/08/2024                             | ISIN                    | LU2607190845 |                              |       |
| NAV (04/02/2025)       | USD 16,18                              |                         |              |                              |       |
| Patrimonio Netto (Mln) | 149,37 USD                             |                         |              |                              |       |

(30/09/2024)

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.