

Pictet TR - Diversified Alpha I EUR

Morningstar Categorie Index

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Euro Short Term Rate

Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Alt - Multistrategy

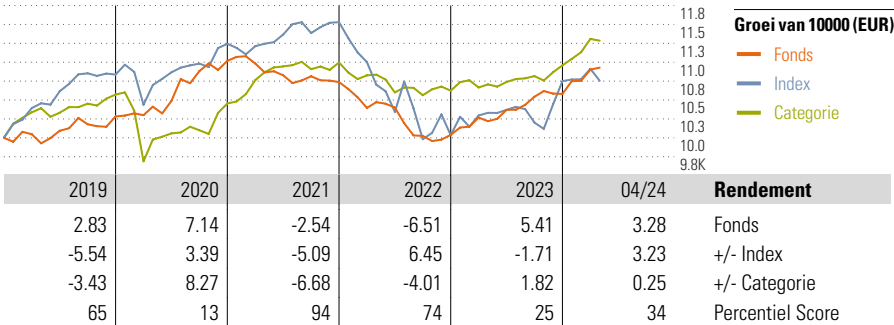
Beleggingsdoelstelling

The Compartment follows a set of long/short investment strategies which are generally market neutral. The objective of the Compartment is to achieve long-term capital growth in absolute terms with a strong focus on capital preservation. Traditional long positions are coupled with (synthetic) long and short positions, which will be achieved through the use of financial derivative instruments (amongst others total return swaps, credit default swaps, futures and options). The Compartment will principally invest in bonds...

Risicomaatstaven

Alpha	-1.17	Sharpe Ratio	-0.42
Beta	-0.04	Std Deviatie	2.87
R-kwadraat	0.78	3-jr Risico	- gem
Informatie Ratio	0.24	5-jr Risico	Laag
Tracking Error	6.97	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar EU Cau Gbl Tgt Alloc NR EUR (waar van toepassing)



Rendementen (16 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	2.46	0.94	-0.29
6 Maanden	4.00	-1.15	-0.96
1 jaar	7.15	1.59	0.69
3 jr gean.	0.61	1.53	-1.94
5 jr gean.	2.07	1.22	0.15

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	3.03	-	-	-
2023	2.28	0.99	1.67	0.36
2022	-3.19	0.05	-3.60	0.13
2021	-0.31	-1.42	-0.12	-0.71
2020	0.17	1.82	3.77	1.23

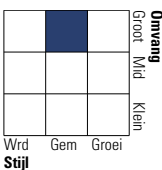
Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

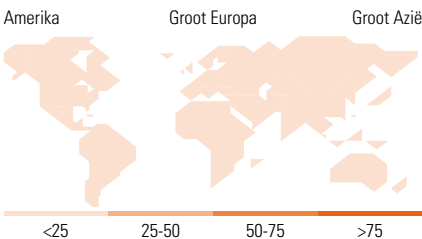
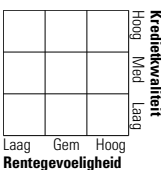
	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	54.71	49.71	5.00
Obligaties	31.89	24.22	7.68
Kas/ geldmarkt	250.61	157.93	92.69
Overig	2.50	7.87	-5.37

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Galderma Group AG Registered...	Pharmaceuticals	2.17
CFD on Banco De Chile2050-12-31	Commodities	1.77
Future on Korea 3 Year...	Commodities	1.54
Totaal Aantal Aandelen		1790
Totaal Aantal Obligaties		183
% Van Vermogen In Top 10 Posities		5.48

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	34.50
Basismaterialen	7.68
Cyclische consumentenproducten	11.40
Financiële dienstverlening	13.66
Vastgoed	1.75
Licht Cyclisch	45.92
Communicatiediensten	5.12
Energie	3.12
Industrie	16.79
Technologie	20.89
Defensief	19.58
Defensieve consumptiegoederen	12.38
Gezondheidszorg	6.42
Nutsbedrijven	0.78

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	28.57
Verenigde Staten	17.62
Canada	0.62
Latijns Amerika	10.32
Groot Europa	39.27
Verenigd Koninkrijk	5.46
West Europa – Euro	15.72
West Europa – Niet Euro	14.13
Emerging Europa	1.73
Midden-Oosten / Afrika	2.23
Groot Azië	32.16
Japan	13.23
Australazië	4.19
Azië - Ontwikkeld	5.58
Azië - Emerging	9.16

Fondsinformatie

Fondsgroep	Pictet Asset Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1,000,000
Telefoon	+352 467 171-1	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.am.pictet	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	1 mei 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Philippe de Weck	ISIN	LU1055714379		
Aanvangsdatum	2 mei 2014				
Koers (16 mei 2024)	EUR 116.76				
Fondsvermogen (mln)	EUR 218.70				