



# iMGP DBi Managed Futures Fund

Condividi classe : I M SEK HP

ISIN : LU2695685342

Gestito da  
**Dynamic Beta Investments LLC**

For professional investors

## Obiettivo d'investimento

- Mira a generare un apprezzamento del capitale a lungo termine implementando una strategia conforme agli UCITS progettata per approssimare i rendimenti tipicamente conseguiti dai fondi alternativi di tipo "managed futures"
- Applica esposizioni lunghe e corte nelle principali classi di attività — indici azionari, titoli di stato o tassi, materie prime e valute — principalmente attraverso contratti futures e forward
- Si basa su processi quantitativi per identificare opportunità direzionali nelle classi di attività, mantenendo una correlazione storicamente bassa con i principali fattori di rischio nel medio-lungo termine
- L'indice SG CTA è utilizzato solo a titolo comparativo, incluso per il confronto delle performance. Il Fondo è gestito attivamente e i poteri discrezionali del Sub-Gestore non sono vincolati dall'indice

## Dati principali

Gestore di fondi	Dynamic Beta Investments LLC
Politica dei dividendi	Accumulating
Ultimo NAV	SEK 11,470.02
Dimensione del fondo	USD 399.2 mn
Classe di attività	Alternative
Zona di investimento	Global
Orizzonte di investimento consigliato	Almeno 4 anni
Valuta della classe di azioni	SEK
Data di inizio della classe di azioni	2023.10.17
Data di attuazione della nuova strategia	-
Struttura giuridica	Luxembourg SICAV - UCITS
Registrazione	SE, LU, SG (QI)
Classificazione SFDR	Articolo 6

## Profilo di rischio/Rendimento della classe

### SRI

RISCHIO PIÙ BASSO  
(RICOMPENSE SOLITAMENTE PIÙ BASSE)

RISCHIO PIÙ ELEVATO  
(RICOMPENSE SOLITAMENTE PIÙ ELEVATE)



## Coefficienti rischio & rendimento



Past performance does not predict future returns.  
Returns may increase or decrease as a result of currency fluctuations for non-USD investors.

Performance mensile	Anno	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec
2026	6.9%	3.4%	7.7%	-3.9%	--	--	--	--	--	--	--	--	--
2025	11.2%	1.1%	-2.4%	-1.7%	-0.8%	0.0%	2.6%	-0.8%	1.3%	5.4%	3.6%	1.9%	0.8%
2024	5.2%	2.0%	3.5%	5.7%	3.9%	-0.5%	1.8%	-3.8%	-3.4%	0.8%	-4.3%	0.9%	-1.0%
2023	-	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-	-4.7%	-2.9%
2022	-	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--
2021	-	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

Performance cumulata	Fondo		Anno solare prestazioni	Fondo		Annualized risk measures	Fondo
1 mese		-3.9%	YTD		6.9%	Volatility	9.4%
3 mesi		6.9%	2025		11.2%	Sharpe ratio	2.2
6 mesi		13.7%	2024		5.2%	Maximum drawdown	-3.9%
1 anno		22.5%	2023		-		
3 anni		-	2022		-		
5 anni		-	2021		-		
Fin dall'inizio		14.7%	2020		-		
			2019		-		
			2018		-		
			2017		-		
Performance annualizzata	Fondo						
3 anni		-					
5 anni		-					
Fin dall'inizio		5.7%					

Annualized risk measures are calculated metrics between the respective reference indexes and the fund. Annualized risk measures based on 5-year monthly returns or 3-year returns if less than 5-year history or 1-year if less than 3-year history.

Fonte: iM Global Partner Asset Management.

I rendimenti possono aumentare o diminuire a causa delle fluttuazioni valutarie per gli investitori la cui valuta di riferimento è diversa dalla valuta della Classe di azioni. Le misure di rischio annualizzate si basano sui rendimenti settimanali a 3 anni se i dati storici superano i 3 anni, oppure a 1 anno se inferiore a 3 anni di dati storici.

## iMGP DBi Managed Futures Fund

Condividi classe : I M SEK HP

For professional investors

## Commento del gestore

## Fatti salienti

Performance cumulata	Fondo
1 mese	-3.9%
YTD	6.9%

## Analisi dei mercati

## Analisi del fondo

## Previsioni

## Composizione del portafoglio

## Allocazione a derivati azionari e obbligazionari

Petrolio	12.4%
Oro	10.2%
Azioni	2.3%
Obbligazioni	-62.8%

## Durata derivati obbligazionari

Scadenze brevi	-1.7
Scadenze intermedie	-3.5
Scadenze lunghe	-1.1

## Allocazione a derivati valutari

JPY	51.0%
EUR	41.9%
EM FX	14.0%
GBP	4.5%
CHF	2.8%
AUD	2.0%
SEK	1.0%
USD	-122.9%
Altre valute MD	5.8%

## Esposizione a derivati azionari per regione

Emerging Countries	17.8%
EMU	9.6%
Europe ex-EMU	9.0%
Japan	6.8%
Asia ex Japan	3.1%
North America	-44.2%
Liquidità e Altri Attivi	0.2%

Fonte: iM Global Partner Asset Management

## iMGP DBi Managed Futures Fund

Condividi classe : I M SEK HP

For professional investors

## Informazioni sulla negoziazione

Liquidità	Daily
Ora limite	TD 12:00 Luxembourg
Investimento minimo iniziale	100,000,000
Regolamento	TD+2
ISIN	LU2695685342
No di valore CH	129871794
Bloomberg	IMDMIMS LX

## Costi

Sottoscrizione	Massimo 0.00%
Rimborso	Massimo 0.00%
Max management fee	0.75%
Effective management fee	0.55%
Commissione di performance	-

## Informazioni amministrative

Amministrazione centrale	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Agente di trasferimento	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Banca depositaria	CACEIS Bank, Luxembourg Branch

Revisori	PwC Luxembourg
Società di gestione	iM Global Partner Asset Management S.A.

## Informazioni importanti

Il presente **documento di marketing** è stato pubblicato dal fondo di investimento iMGP SICAV (di seguito denominato "iMGP" o il "Fondo"). Esso non è destinato alla distribuzione o all'utilizzo da parte di persone fisiche o giuridiche cittadine o residenti in uno Stato, un Paese o una giurisdizione le cui leggi applicabili ne vietino la distribuzione, la pubblicazione, l'emissione o l'utilizzo. Gli utenti hanno la responsabilità esclusiva di verificare di essere legalmente autorizzati a consultare le informazioni contenute nel presente documento. **Eventuali decisioni di investimento devono basarsi solo sulla versione più recente del prospetto, del documento contenente le informazioni chiave (KID), dello statuto e delle relazioni annuali e semestrali di iMGP (di seguito la "documentazione legale" d'iMGP).** Questi documenti sono disponibili sul sito web, [www.imgp.com](http://www.imgp.com), o presso gli uffici di iMGP siti in 5, Allée Scheffer, L-2520 Lussemburgo. Per la Svizzera, il prospetto, il documento contenente le informazioni chiave, la relazione annuale e semestrale e lo statuto possono essere richiesti gratuitamente a CACEIS (Svizzera) SA- 35 Route de Signy - CH-1260 Nyon, rappresentante per la Svizzera e CACEIS Bank, Parigi, succursale di Nyon/Svizzera, agente pagatore per la Svizzera. In Italia, il Prospetto e il KID sono disponibili, in lingua italiana, presso i soggetti incaricati del collocamento e sul sito web [www.imgp.com](http://www.imgp.com). L'elenco dei soggetti incaricati del collocamento è disponibile nel medesimo sito web.

Le informazioni o i dati contenuti nel presente documento non costituiscono in alcun modo un'offerta o una raccomandazione per l'acquisto o la vendita di azioni dei comparti del Fondo. Inoltre, qualsiasi riferimento nel presente documento a titoli specifici non dovrà essere interpretato come una raccomandazione o un consiglio di investimento nei medesimi titoli. Tali indicazioni sono fornite unicamente al fine d'informare l'investitore sulle passate performance e non riflettono l'opinione di iMGP, o di società ad essa collegate, sulle future potenzialità. Le informazioni, le opinioni e le valutazioni contenute nel presente documento si applicano al momento della pubblicazione e possono essere revocate o modificate senza preavviso. iMGP non ha preso misure per adattarsi a ogni singolo investitore, che rimane responsabile delle proprie decisioni. Si consiglia inoltre agli investitori di rivolgersi ai propri consulenti legali, finanziari o fiscali prima di prendere qualsiasi decisione d'investimento. Il regime fiscale dipende interamente dalla situazione finanziaria di ogni investitore ed è passibile di modifica. Si raccomanda agli investitori di ottenere l'opportuno parere di un esperto prima di prendere decisioni di investimento. Il presente documento di marketing non intende in alcun modo sostituire la documentazione legale e/o le informazioni che gli investitori ottengono dai propri consulenti finanziari.

Il valore delle quote a cui si fa riferimento può fluttuare e gli investitori potrebbero non recuperare in tutto o in parte l'importo inizialmente investito. Si prega gli investitori di consultare il prospetto iMGP per ulteriori dettagli sui rischi connessi. **I risultati passati non sono indicativi dei risultati futuri.** I calcoli avvengono nella moneta dei comparti e gli investimenti effettuati in moneta diversa possono essere soggetti alle oscillazioni dei tassi di cambio. I dati riguardanti i risultati non comprendono le commissioni né le spese relative alla sottoscrizione e/o al riacquisto di azioni. **I rendimenti sono calcolati al netto delle commissioni nelle valute di riferimento degli specifici comparti.** Essi riflettono le spese correnti, comprendono le commissioni di gestione ed eventualmente anche le commissioni di rendimento dedotte dai comparti. Tutti i rendimenti sono calcolati NAV su NAV con dividendi reinvestiti. Salvo laddove diversamente indicato, la performance dei comparti è indicata sulla base di un rendimento totale, compresi i dividendi o eventuali altre distribuzioni rilevanti. **Tutti i rendimenti sono al lordo di qualsiasi detrazione di imposta a cui un investitore potrebbe essere soggetto.** È possibile che delle società collegate a iMGP e i loro dirigenti, direttori o personale detengano o abbiano detenuto partecipazioni o posizioni in titoli citati nel presente documento, o che abbiano negoziato o siano intervenuti in qualità di market maker riguardo a tali titoli. È altresì possibile che tali organismi o persone abbiano avuto legami passati o attuali con i dirigenti delle società che emettono le summenzionate azioni; che forniscano o abbiano fornito servizi finanziari o di altro tipo; o che siano o siano stati direttori delle suddette società. Ricordiamo che qualsiasi riferimento a un indice ha esclusivamente finalità informative. La performance del Comparto potrebbe differire dalla performance dell'indice. I dati del fornitore dell'indice non possono essere riprodotti né ripubblicati in nessun modo e non possono essere utilizzati come base o componente di strumenti o prodotti finanziari o indici. Si ritiene che l'indicatore di rischio indica il rischio legato al fondo. Può variare da 1 a 7. L'appartenenza alla categoria 1 non indica un investimento nel fondo privo di rischio. L'indicatore è basato su dati storici e non può pertanto garantire il livello di rischio futuro del fondo. L'indicatore non può inoltre essere inteso come un obiettivo di investimento del fondo e pertanto può subire variazioni nel tempo. In conformità all'articolo 93-bis della Direttiva 2009/65/CE, il Fondo potrebbe decidere di porre fine alla commercializzazione delle proprie azioni in Italia. **Per ottenere informazioni complete sui rischi associati all'investimento e per una sintesi dei diritti degli investitori si prega di fare riferimento al Prospetto iMGP. Per ulteriori informazioni, si prega di fare riferimento al Prospetto e al documento contenente le informazioni chiave (KID).** Il Prospetto e i KID sono pubblicati presso le competenti Autorità di Vigilanza.