

PriviEdge Graham Quant Macro MA USD Acc

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001007

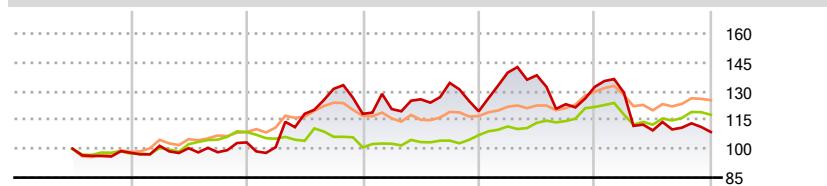
Benchmark Morningstar
Morningstar US Conservative Target
Allocation NR USD
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund is actively managed and is not managed in reference to a benchmark. The Sub-Fund's objective is to achieve long-term investment returns by investing in a directional, long and short strategy that utilizes fundamental and price-based indicators to establish return forecasts across global interest rates, foreign exchange and stock indices. Quantitative risk management and portfolio construction techniques are used to diversify risk across the portfolio and seek to enhance risk-adjusted returns. The strategy is designed to have low correlation to traditional markets and other alternative strategies and has the potential to provide significant portfolio diversification benefits.

Rendimenti


2021 2022 2023 2024 2025 2026-01

5,48	14,42	1,12	10,63	-17,77	1,64
11,48	-7,32	6,35	13,67	-3,35	-0,59
10,19	8,94	1,33	10,74	-2,77	1,05

Misure di Rischio

3Y Alpha	-2,22	3Y Sharpe Ratio	-0,26
3Y Beta	-0,50	3Y Std Dev	15,82
3Y R-Squared	6,43	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,52	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	13,55	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %
Fondo
Bmk
Cat
Rendimenti Trimestrali %
Q1
Q2
Q3
Q4

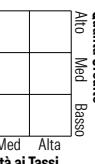
2026	-	-	-	-
2025	-2,18	-15,27	1,26	-2,01
2024	16,86	-1,02	-10,88	7,32
2023	2,10	4,20	6,79	-10,99
2022	-2,41	17,25	11,01	-9,91

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %

Azioni	119,29
Obbligazioni	667,33
Liquidità	-686,6
Altro	0,00

Fixed Income Style
Box™

Fondo

Duration Effettiva

Maturity effettiva

Qualità Credito Media

Rendimenti
Q1
Q2
Q3
Q4

Trimestrale %

2026 - - - -

2025 -2,18 -15,27 1,26 -2,01

2024 16,86 -1,02 -10,88 7,32

2023 2,10 4,20 6,79 -10,99

2022 -2,41 17,25 11,01 -9,91

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Titoli principali

Nome	Settore	%
Swap Graham Ma-Msdscogg	-	95,28
Euro Bobl Future Dec 25	-	41,04
Euro Schatz Future Dec 25	-	40,91
Euro Bund Future Dec 25	-	38,99
JGB LT FUTURE DEC25	-	21,70
Hang Seng Index Future Oct 25	-	19,07
T-BOND 30YR FUTURE DEC25	-	10,68
Long Gilt Future Dec 25	-	10,67
E-mini Russell 2000 Index...	-	9,12
Future On Nasdaq 100 Dec25	-	8,97
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		296,45
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		29

Fixed Income Sector Weightings %
Fondo

Governativo	653,87
Societario	17,96
Cartolarizzazioni	1,86
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-629,07
Derivati	-63,92

Coupon Range %
Fondo

0 coupon	0,00
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
America 0,00

Stati Uniti -

Canada -

America Latina e Centrale -

Europa 0,00

Regno Unito -

Europa Occidentale - Euro -

Europa Occidentale - Non Euro -

Europa dell'Est -

Africa -

Medio Oriente -

Asia 0,00

Giappone -

Australasia -

Asia - Paesi Sviluppati -

Asia - Emergenti -

Anagrafica

Società di Gestione	Graham Capital Management LP	Patrimonio Classe (Mln)	12,03 USD	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	2038993400	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,43%
Web	www.grahamcapital.com	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,44%
Data di Partenza	17/06/2020	UCITS	Si	Commissione di incentivo	15,00%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	17/06/2020	ISIN	LU2183933816		
NAV (30/01/2026)	USD 11,82				

PrivilEdge Graham Quant Macro MA USD Acc

Patrimonio Netto (Mln)

129,94 USD

(30/09/2025)