

# PriveEdge Graham Quant Macro PA 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

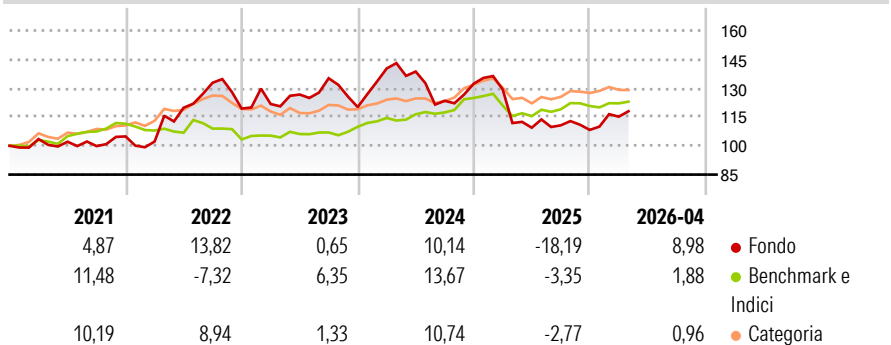
The Sub-Fund is actively managed and is not managed in reference to a benchmark. The Sub-Fund's objective is to achieve long-term investment returns by investing in a directional, long and short strategy that utilizes fundamental and price-based indicators to establish return forecasts across global 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.

### Misure di Rischio

|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -2,80 | 3Y Sharpe Ratio | -0,17 |
| 3Y Beta           | -0,01 | 3Y Std Dev      | 14,99 |
| 3Y R-Squared      | 0,00  | 3Y Risk         | Alto  |
| 3Y Info Ratio     | -0,52 | 5Y Risk         | +Med  |
| 3Y Tracking Error | 12,42 | 10Y Risk        | -     |

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

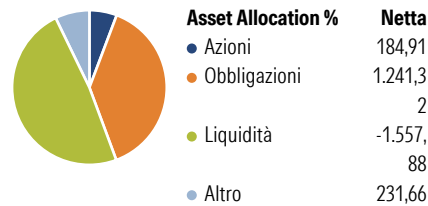
### Rendimenti



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk  | Cat  | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2     | Q3     | Q4     |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|--------|--------|--------|
| 3-Mesi           | 7,31  | 1,85 | 0,74 | 2026                     | 6,36  | -      | -      | -      |
| 6-Mesi           | 7,90  | 2,49 | 1,94 | 2025                     | -2,30 | -15,38 | 1,12   | -2,15  |
| 1-Anno           | 5,99  | 4,27 | 1,83 | 2024                     | 16,72 | -1,13  | -10,97 | 7,21   |
| 3-Anni Ann.ti    | -0,30 | 5,24 | 2,81 | 2023                     | 1,98  | 4,07   | 6,67   | -11,10 |
| 5-Anni Ann.ti    | 4,08  | 4,29 | 4,61 | 2022                     | -2,55 | 17,23  | 10,88  | -10,14 |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -    | -    |                          |       |        |        |        |

Rendimenti aggiornati al 15/05/2026

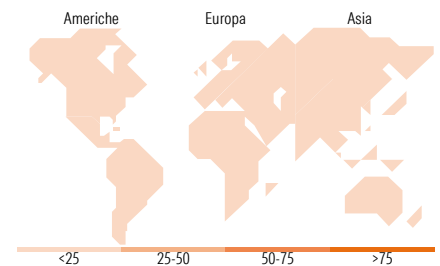
### Portafoglio 31/01/2026



### Fixed Income Style Box™

| Qualità Credito |     | Sensibilità ai Tassi |
|-----------------|-----|----------------------|
| Alto            | Med |                      |
|                 |     | Basso                |
|                 |     | Med                  |
|                 |     | Alta                 |

Fondo  
Duration Effettiva -  
Maturità effettiva -  
Qualità Credito Media



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %      |
|---|---------|--------|
| Swap Graham Ma-Msdscogq                     | -       | 231,66 |
| 10 Year Treasury Note Future...             | -       | 57,67  |
| Euro Bund Future Mar 26                     | -       | 55,89  |
| Euro Schatz Future Mar 26                   | -       | 50,52  |
| Future on TOPIX                             | -       | 49,35  |
| Euro Bobl Future Mar 26                     | -       | 45,59  |
| E-mini Russell 2000 Index...                | -       | 43,59  |
| T-BOND 30YR FUTURE MAR26                    | -       | 41,77  |
| Long Gilt Future Mar 26                     | -       | 39,09  |
| Hang Seng Index Future Feb 26               | -       | 29,24  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 644,37 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0      |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 29     |

### Fixed Income Sector Weightings %

|                          | Fondo    |
|--------------------------|----------|
| Governativo              | 1.210,66 |
| Societario               | 39,70    |
| Cartolarizzazioni        | 3,19     |
| Enti Locali              | 0,00     |
| Liquidità ed equivalenti | -814,11  |
| Derivati                 | -756,00  |

### 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       |
|-------------------------------|-------------|
| <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 - Emergente              | -           |

### Anagrafica

|                      |                              |                         |              |                              |           |
|----------------------|------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione  | Graham Capital Management LP | Patrimonio Classe (Mln) | 0,43 USD     | Investimento Min. Ingresso   | 3.000 EUR |
| Telefono             | 2038993400                   | (15/05/2026)            |              | Investimento Min. Successivo | 1 EUR     |
| Web                  | www.grahamcapital.com        | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | -         |
| Data di Partenza     | 17/06/2020                   | Valuta del Fondo        | USD          | Spese correnti               | 1,98%     |
| Nome del Gestore     | -                            | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | 15,00%    |
| Data Inizio Gestione | 17/06/2020                   | Inc/Acc                 | Acc          |                              |           |
| NAV (15/05/2026)     | USD 12,37                    | ISIN                    | LU2183933907 |                              |           |

# PrivilEdge Graham Quant Macro PA USD Acc

Patrimonio Netto (Mln)

81,47 USD

(31/01/2026)