

# PrivilEdge Graham Quant Macro MA CHF Syst Hged Acc

## Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001008

## Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

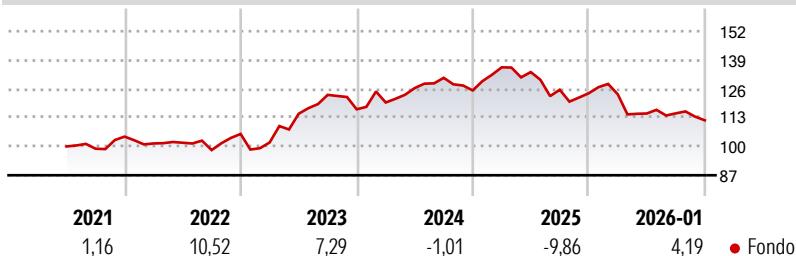
## Morningstar Rating™

Senza 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



### Misure di Rischio

3Y Alpha	- 3Y Sharpe Ratio	-0,29
3Y Beta	- 3Y Std Dev	9,87
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

### Rend. Cumulati %

3-Mesi	0,50
6-Mesi	-0,47
1-Anno	-7,49
3-Anni Ann.ti	-0,35
5-Anni Ann.ti	2,53
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

### Fondo

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-0,40	-7,01	0,06	-2,74
2024	8,33	-1,58	-5,97	-1,25
2023	2,63	5,44	3,65	-4,34
2022	-3,64	12,73	7,43	-5,28

### Portafoglio 30/09/2025

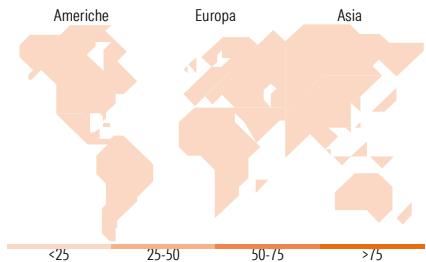


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	119,29
● Obbligazioni	667,33
● Liquidità	-686,6
● Altro	2
	0,00

### Fixed Income Style

Box™	Duration Effettiva	Fondo
Qualità Credito	Maturity effettiva	-
Basso	Qualità Credito Media	-
Bassa	Duration Effettiva	-
Med	Maturity effettiva	-
Alta	Qualità Credito Media	-

Qualità Credito  
Basso Med Alta  
Sensibilità ai Tassi



&lt;25 25-50 50-75 &gt;75

### Titoli principali

Nome	Settore	%
Swap Graham Ma-Msdscogq	-	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
<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 - Emergenti	-

### Anagrafica

Società di Gestione	Graham Capital Management LP	Patrimonio Classe (Mln)	2,05 CHF	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	2038993400	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.grahamcapital.com	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	1,43%
Data di Partenza	17/06/2020	UCITS	Si	Spese correnti	1,44%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	17/06/2020	ISIN	LU2183934384		
NAV (30/01/2026)	CHF 10,12				

# PriviEdge Graham Quant Macro MA CHF Syst Hedged Acc

Patrimonio Netto (Mln)

129,94 USD

(30/09/2025)