PrivilEdge Graham Quant Macro MA EUR Syst Hedged Acc

Categoria Morningstar™
Alt - Global Macro

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

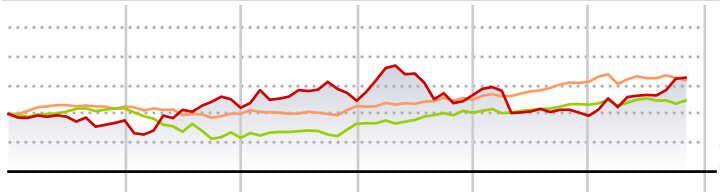
Benchmark Dichiarato
Not Benchmarked

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	2026-10
Fondo	-2,90	5,88	3,11	2,36	-8,58	17,34
Benchmark e Indici	2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58	1,77
Categoria	3,17	-2,39	3,79	2,91	8,30	0,62

Misure di Rischio

3Y Alpha	-0,94	3Y Sharpe Ratio	-0,05
3Y Beta	0,12	3Y Std Dev	11,13
3Y R-Squared	0,19	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,35	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	11,72	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,30	-0,84	-2,57
6-Mesi	4,43	0,72	-2,79
1-Anno	11,91	1,85	-1,11
3-Anni Ann.ti	1,06	5,13	4,93
5-Anni Ann.ti	3,25	0,63	1,02
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 12/11/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	3,96	5,33	6,70	-
2025	1,81	-8,43	0,71	-2,64
2024	13,89	-2,06	-7,52	-0,77
2023	3,48	4,15	3,32	-7,40
2022	-4,70	10,10	3,54	-2,54

Portafoglio 31/07/2026

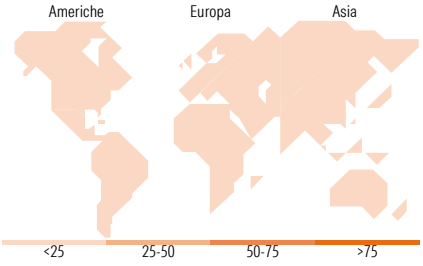


Asset Allocation %	Netta
Azioni	413,02
Obbligazioni	-2.616,35
Liquidità	1.406,80
Altro	896,52

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Swap Graham Ma-Msdscogq	—	896,51
E-mini S&P 500 Future Sept 26	—	148,55
DOW JONES MINI FUT SEP26	—	84,18
Dax Future Sept 26	—	83,49
E-mini Russell 2000 Index...	—	74,63
Euro Bund Future Sept 26	—	38,69
JGB LT FUTURE SEP26	—	37,43
Hang Seng Index Future Aug 26	—	31,12
CAC 40 Index Future Aug 26	—	25,82
Ftse 100 Future Sep26	—	24,76
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		1.445,19
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		31

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	-2.697,48
Societario	96,17
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	1.751,82
Derivati	-360,06

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 - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Graham Capital Management LP
Telefono	2038993400
Web	www.grahamcapital.com
Data di Partenza	17/06/2020
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	17/06/2020
NAV (12/11/2026)	EUR 12,30
Patrimonio Classe (Mln) (12/11/2026)	2,38 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2183934111
Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Investimento Min. Successivo	1 EUR
T.E.R.	1,82%
Spese correnti	1,44%
Commissione di incentivo	15,00%

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

PrivilEdge Graham Quant Macro MA EUR Syst Hedged Acc

Patrimonio Netto (Mln)	43,72 USD
(31/07/2026)	

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.