

Premium Funds SICAV - Multi Alternative Risk Premia Fund 2X EUR Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

No benchmark

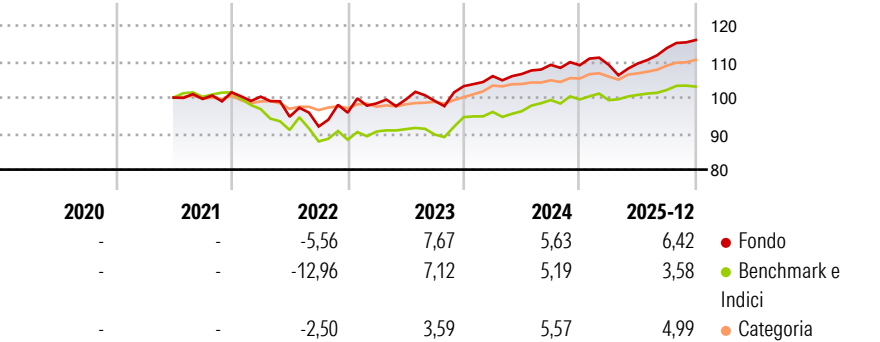
Morningstar Rating™

★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of this Sub-fund is to achieve long-term capital appreciation investing in a systematic way in globally diversified multi asset risk premia, while maintaining the Sub-fund around an objective of annual volatility with a target around 6%.

Rendimenti



Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 1,16 | 3Y Sharpe Ratio | 0,66 |
| 3Y Beta | 1,05 | 3Y Std Dev | 5,38 |
| 3Y R-Squared | 62,87 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | 0,39 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 3,30 | 10Y Risk | - |

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

Rend. Cumulati %

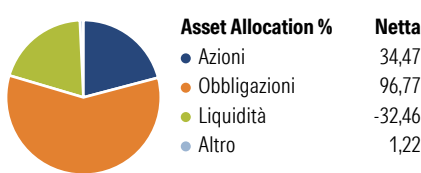
| | Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|-------|------|------|
| 3-Mesi | 3,07 | 0,41 | 3,14 |
| 6-Mesi | 7,46 | 2,55 | 5,98 |
| 1-Anno | 7,47 | 3,32 | 6,84 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,87 | 4,66 | 5,56 |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Rendimenti

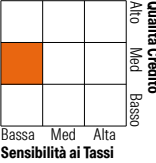
| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------------|-------|-------|-------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | 0,10 | 0,35 | 3,90 | 1,97 |
| 2024 | 2,71 | 0,55 | 2,38 | -0,10 |
| 2023 | 2,70 | 1,06 | -0,37 | 4,13 |
| 2022 | -1,19 | -5,55 | -2,87 | 4,18 |

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style

Box™

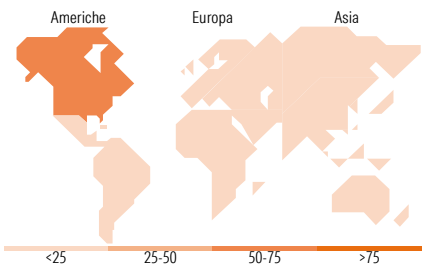


Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|--------|
| Governativo | 29,85 |
| Societario | 75,50 |
| Cartolarizzazioni | 2,68 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | -55,14 |
| Derivati | 47,11 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 31,72 |
| Da 0 a 4 cedole | 57,15 |
| Da 4 a 6 cedole | 9,50 |
| Da 6 a 8 cedole | 1,24 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,38 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,01 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| E-mini S&P 500 Future Dec 25 | — | 10,09 |
| Citigroup Global Markets... | — | 5,15 |
| Natixis S.A. 0% | — | 4,11 |
| Natixis S.A. 0% | — | 3,96 |
| MSCI Emerging Markets Index... | — | 3,15 |
| E-mini Nasdaq 100 Future Dec... | — | 3,00 |
| S&P TSX 60 Index Future Dec 25 | — | 2,57 |
| Bank of Ireland Group PLC... | — | 2,51 |
| ASX SPI 200 Index Future Dec... | — | 2,26 |
| Ftse 100 Idx Fut Dec25 | — | 2,20 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 38,99 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 3 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 71 |

Anagrafica

| | | | | | |
|----------------------|--|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione | Generali Asset Management S.p.A. Società di gestione del risparmio | Patrimonio Classe (Mln) | 7,20 EUR | Investimento Min. Ingresso | 1.000.000 EUR |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | 1.000.000 EUR |
| Web | www.generali-investments.de | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 24/06/2021 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,78% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | 20,00% |
| Data Inizio Gestione | 29/11/2019 | ISIN | LU2036692593 | | |
| NAV (29/01/2026) | EUR 119,07 | | | | |

Premium Funds SICAV - Multi Alternative Risk Premia Fund 2X EUR Acc

| | |
|------------------------|------------|
| Patrimonio Netto (Mln) | 515,25 EUR |
| (30/11/2025) | |