

# 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

Not Benchmarked

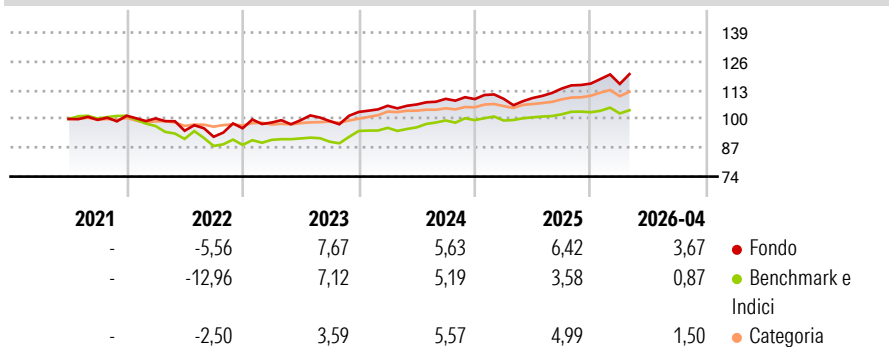
## Morningstar Rating™

★★★★

### 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          | 1,76  | 3Y Sharpe Ratio | 0,62 |
| 3Y Beta           | 1,11  | 3Y Std Dev      | 5,72 |
| 3Y R-Squared      | 64,13 | 3Y Risk         | +Med |
| 3Y Info Ratio     | 0,56  | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | 3,47  | 10Y Risk        | -    |

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

### Rend. Cumulati %

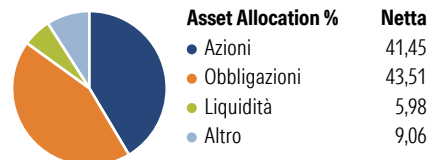
|                | Fondo | Bmk   | Cat  |
|----------------|-------|-------|------|
| 3-Mesi         | 2,14  | -0,14 | 0,58 |
| 6-Mesi         | 5,46  | 0,61  | 3,63 |
| 1-Anno         | 13,90 | 4,22  | 8,31 |
| 3-Anni Ann.ti  | 7,21  | 4,56  | 6,26 |
| 5-Anni Ann.ti  | -     | -     | -    |
| 10-Anni Ann.ti | -     | -     | -    |

Rendimenti aggiornati al 11/05/2026

### Rendimenti

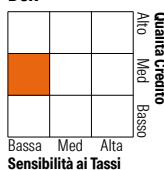
|      | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | -0,16 | -     | -     | -     |
| 2025 | 0,10  | 0,35  | 3,90  | 1,97  |
| 2024 | 2,71  | 0,55  | 2,38  | -0,10 |
| 2023 | 2,70  | 1,06  | -0,37 | 4,13  |
| 2022 | -1,19 | -5,55 | -2,87 | 4,18  |

### Portafoglio 31/03/2026

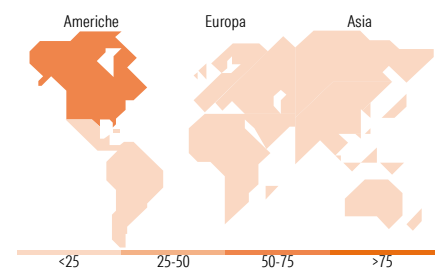


### Fixed Income Style

#### Box™



|                       | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Duration Effettiva    | 2,02  |
| Maturity effettiva    | 0,83  |
| Qualità Credito Media | A     |



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| E-mini S&P 500 Future June 26               | -       | 10,75 |
| Citigroup Global Markets...                 | -       | 5,59  |
| Natixis S.A. 0%                             | -       | 4,45  |
| Total Return Swap (F)                       | -       | 4,21  |
| Natixis S.A. 0%                             | -       | 4,06  |
| Merrill Lynch B.V. 0.01125%                 | -       | 3,88  |
| S&P TSX 60 Index Future June...             | -       | 3,57  |
| MSCI Emerging Markets Index...              | -       | 3,47  |
| E-mini Nasdaq 100 Future...                 | -       | 3,25  |
| 3 Year Australian Treasury...               | -       | 2,92  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 46,16 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 74    |

### Fixed Income Sector Weightings %

|                          | Fondo  |
|--------------------------|--------|
| Governativo              | 43,11  |
| Societario               | 103,81 |
| Cartolarizzazioni        | 3,57   |
| Enti Locali              | 0,00   |
| Liquidità ed equivalenti | -41,51 |
| Derivati                 | -8,98  |

### Coupon Range %

|                   | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 32,48 |
| Da 0 a 4 cedole   | 50,87 |
| Da 4 a 6 cedole   | 14,44 |
| Da 6 a 8 cedole   | 1,40  |
| Da 8 a 10 cedole  | 0,67  |
| Da 10 a 12 cedole | 0,07  |
| Oltre 12 cedole   | 0,08  |

### Ripartizione Geografica %

|                               | Fondo        |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>65,79</b> |
| Stati Uniti                   | 54,66        |
| Canada                        | 10,15        |
| America Latina e Centrale     | 0,98         |
| <b>Europa</b>                 | <b>16,99</b> |
| Regno Unito                   | 7,38         |
| Europa Occidentale - Euro     | 8,11         |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,42         |
| Europa dell'Est               | 0,21         |
| Africa                        | 0,32         |
| Medio Oriente                 | 0,56         |
| <b>Asia</b>                   | <b>17,22</b> |
| Giappone                      | 0,02         |
| Australasia                   | 6,57         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 4,00         |
| Asia - Emergente              | 6,63         |

### Anagrafica

|                      |  |                         |              |                              |               |
|----------------------|--|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione  | Generali Asset Management S.p.A. Società di gestione del risparmio | Patrimonio Classe (Mln) | 6,16 EUR     | Investimento Min. Ingresso   | 1.000.000 EUR |
|                      |  | (11/05/2026)            |              | Investimento Min. Successivo | 1.000.000 EUR |
|                      |  | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | -             |
| Telefono             | -  | Valuta del Fondo        | EUR          | Spese correnti               | 0,78%         |
| Web                  | www.generali-investments.de  | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | 20,00%        |
|                      |  | Inc/Acc                 | Acc          |                              |               |
| Data di Partenza     | 24/06/2021   | ISIN                    | LU2036692593 |                              |               |
| Nome del Gestore     | -  |                         |              |                              |               |
| Data Inizio Gestione | 29/11/2019   |                         |              |                              |               |
| NAV (11/05/2026)     | EUR 122,03   |                         |              |                              |               |

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

Patrimonio Netto (Mln) 509,72 EUR

(31/03/2026)