

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

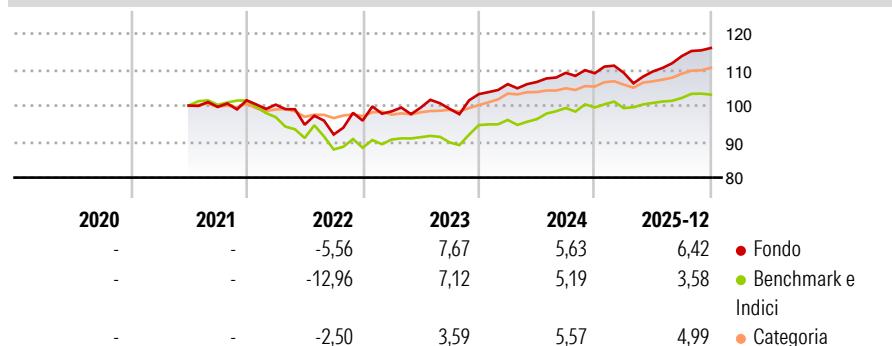
No benchmark

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%.

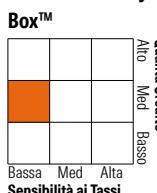
Rendimenti

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	-

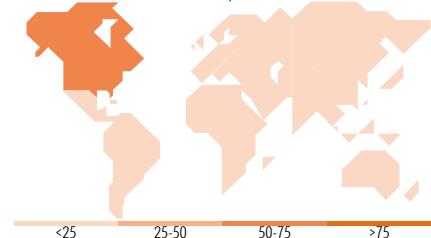
Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %
Fondo
Bmk
Cat
Rendimenti Trimestrali %
Q1
Q2
Q3
Q4
2026
2025
2024
2023
2022
2021
2020
Portafoglio 30/11/2025


Asset Allocation %	Netta
• Azioni	34,47
• Obbligazioni	96,77
• Liquidità	-32,46
• Altro	1,22

Fixed Income Style Box™


Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo
Americhe
Europa
Asia

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	
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	3	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	71	

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

Ripartizione Geografica %
Fondo

America	76,03
Stati Uniti	64,66
Canada	8,49
America Latina e Centrale	2,88
Europa	5,51
Regno Unito	0,10
Europa Occidentale - Euro	4,12
Europa Occidentale - Non Euro	0,14
Europa dell'Est	0,20
Africa	0,37
Medio Oriente	0,59
Asia	18,45
Giappone	0,04
Australasia	7,04
Asia - Paesi Sviluppati	3,57
Asia - Emergenti	7,81

Anagrafica

Società di Gestione	Generali Asset Management S.p.A. Società di gestione del risparmio	Patrimonio Classe (Mln) (29/01/2026)	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				

© 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 produttori; (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.

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

Patrimonio Netto (Mln)

515,25 EUR

(30/11/2025)