Generali Multi Portfolio Solutions SICAV - Multi Alternative Risk Premia Fund

Categoria Morningstar™
2X EUR Acc
Alt - Multi-Strategy

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

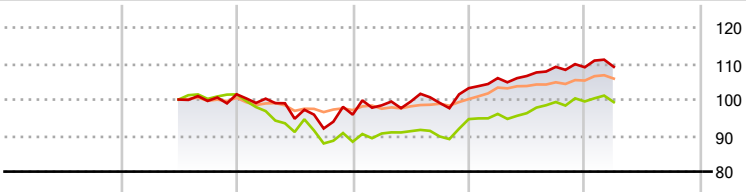
Benchmark Dichiarato
No benchmark

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



	2020	2021	2022	2023	2024	2025-03
Fondo	-	-	-5,56	7,67	5,63	0,10
Benchmark e Indici	-	-	-12,96	7,12	5,19	-0,20
Categoria	-	-	-2,50	3,59	5,57	0,56

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,97	3Y Sharpe Ratio	0,08
3Y Beta	0,97	3Y Std Dev	7,11
3Y R-Squared	76,02	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,58	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	3,44	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-3,87	-0,75	-1,51
6-Mesi	-2,57	1,30	-0,41
1-Anno	0,87	5,22	1,85
3-Anni Ann.ti	2,36	1,89	1,33
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 29/04/2025

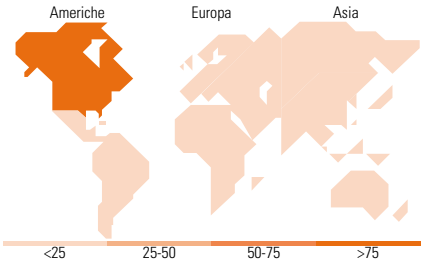
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	0,10	-	-	-
2024	2,71	0,55	2,38	-0,10
2023	2,70	1,06	-0,37	4,13
2022	-1,19	-5,55	-2,87	4,18
2021	-	-	-0,38	1,84

Portafoglio 28/02/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	34,51
Obbligazioni	102,07
Liquidità	-36,05
Altro	-0,53

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	1,41
Maturity effettiva	0,86
Qualità Credito Media	A



Titoli principali

Nome	Settore	%
Italy (Republic Of) 0%	—	7,82
E-mini S&P 500 Future Mar 25	—	6,60
Citigroup Global Markets...	—	4,96
Natixis S.A. 0%	—	3,98
Euro Stoxx 50 Mar25	—	3,94
France (Republic Of) 1%	—	3,70
S&P TSX 60 Index Future Mar 25	—	3,52
E-mini Nasdaq 100 Future Mar...	—	3,38
10 Year Government of Canada...	—	3,36
Spain (Kingdom of) 0%	—	3,27
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		44,53
Numero Complessivo di Titoli Azionari		6
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		89

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	66,27
Societario	51,83
Cartolarizzazioni	1,80
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-66,92
Derivati	47,02

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	21,58
Da 0 a 4 cedole	69,27
Da 4 a 6 cedole	7,10
Da 6 a 8 cedole	1,57
Da 8 a 10 cedole	0,47
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	**76,72**
Stati Uniti	62,57
Canada	13,25
America Latina e Centrale	0,90
Europa	**4,96**
Regno Unito	0,15
Europa Occidentale - Euro	3,28
Europa Occidentale - Non Euro	0,09
Europa dell'Est	0,24
Africa	0,35
Medio Oriente	0,84
Asia	**18,32**
Giappone	0,00
Australasia	8,83
Asia - Paesi Sviluppati	3,40
Asia - Emergente	6,09

Anagrafica

Società di Gestione	Generali Investments Luxembourg SA
Telefono	35 228 373 728
Web	www.generali-investments.lu
Data di Partenza	24/06/2021
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	29/11/2019
NAV (29/04/2025)	EUR 106,51
Patrimonio Netto (Mln) (28/02/2025)	510,12 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (29/04/2025)	4,50 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2036692593
Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,78%
Commissione di incentivo	20,00%

© 2025 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.