

# PrivilEdge Graham Quant Macro NA 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

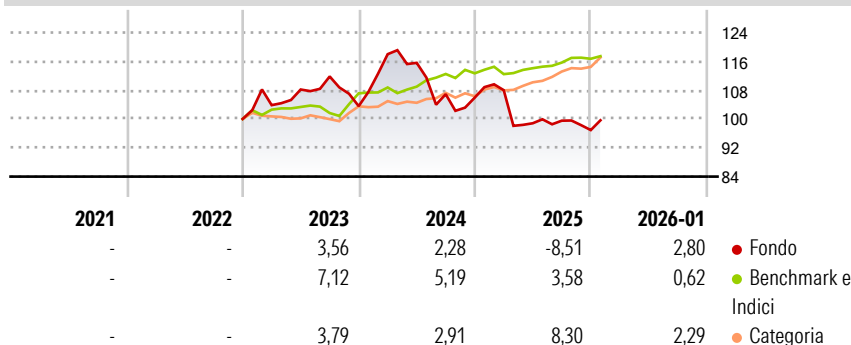
The Sub-Fund is actively managed and is not managed in reference to a benchmark. The Sub-Fund's objective is to achieve long-term investment returns by investing in a directional, long and short strategy that utilizes fundamental and price-based indicators to establish return forecasts across global 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.

### Misure di Rischio

3Y Alpha	-2,37	3Y Sharpe Ratio	-0,30
3Y Beta	-0,55	3Y Std Dev	11,12
3Y R-Squared	3,64	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,45	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	12,46	10Y Risk	-

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

### Rendimenti

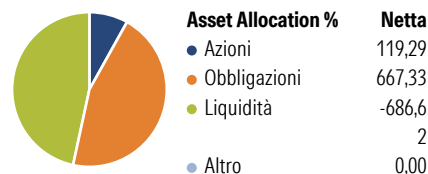


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-0,12	0,54	2,79
6-Mesi	-0,85	2,87	6,95
1-Anno	-8,12	3,46	9,27
3-Anni Ann.ti	-1,07	4,33	4,29
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	1,95	-8,50	0,73	-2,62
2024	13,93	-2,04	-7,53	-0,89
2023	3,83	4,18	3,35	-7,37
2022	-	-	-	-

### Portafoglio 30/09/2025



### Fixed Income Style

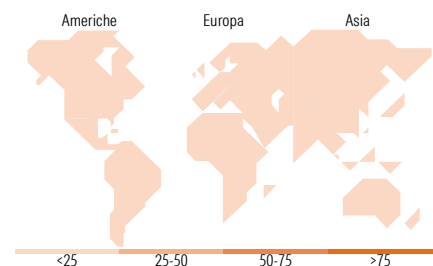
#### Box™


Qualità Credito

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

### Fondo



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Swap Graham Ma-Msdscogg	—	95,28
Euro Bobl Future Dec 25	—	41,04
Euro Schatz Future Dec 25	—	40,91
Euro Bund Future Dec 25	—	38,99
JGB LT FUTURE DEC25	—	21,70
Hang Seng Index Future Oct 25	—	19,07
T-BOND 30YR FUTURE DEC25	—	10,68
Long Gilt Future Dec 25	—	10,67
E-mini Russell 2000 Index...	—	9,12
Future On Nasdaq 100 Dec25	—	8,97
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		296,45
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		29

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	653,87
Societario	17,96
Cartolarizzazioni	1,86
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-629,07
Derivati	-63,92

### 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
<b>America</b>	<b>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

### Anagrafica

Società di Gestione	Graham Capital Management LP	Patrimonio Classe (Mln)	0,03 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	2038993400	(30/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.grahamcapital.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,35%
Data di Partenza	14/12/2022	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,37%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	17/06/2020	Inc/Acc	Acc		
NAV (30/01/2026)	EUR 10,97	ISIN	LU2211668335		

# PrivilEdge Graham Quant Macro NA EUR Syst Hedged Acc

Patrimonio Netto (Mln)	129,94 USD
(30/09/2025)	