

# PriveEdge Graham Quant Macro MA USD Acc

## Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001007

## Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

## Morningstar Rating™

★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

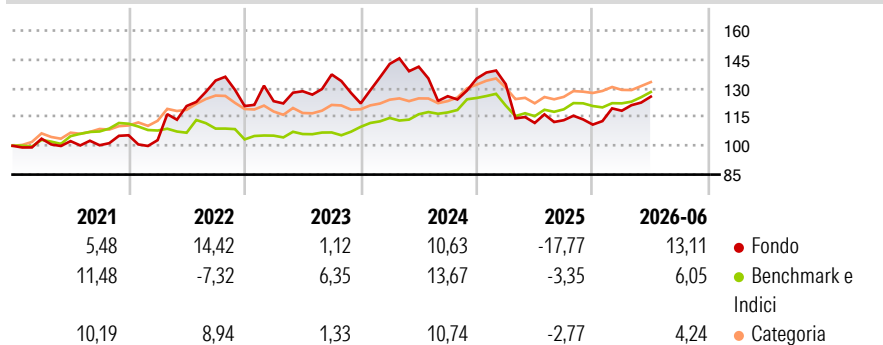
The Sub-Fund is actively managed and is not managed in reference to a benchmark. The Sub-Fund's objective is to achieve long-term investment returns by investing in a directional, long and short strategy that utilizes fundamental and price-based indicators to establish return forecasts across global 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	-3,18	3Y Sharpe Ratio	-0,16
3Y Beta	-0,02	3Y Std Dev	14,94
3Y R-Squared	0,01	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	-0,59	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	12,42	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

### Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,85	4,49	3,86	2026	6,51	6,20	-	-
6-Mesi	13,20	5,90	4,59	2025	-2,18	-15,27	1,26	-2,01
1-Anno	11,91	10,97	9,02	2024	16,86	-1,02	-10,88	7,32
3-Anni Ann.ti	-0,71	6,39	4,35	2023	2,10	4,20	6,79	-10,99
5-Anni Ann.ti	4,11	3,91	4,41	2022	-2,41	17,25	11,01	-9,91
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 01/07/2026

### Portafoglio 28/02/2026

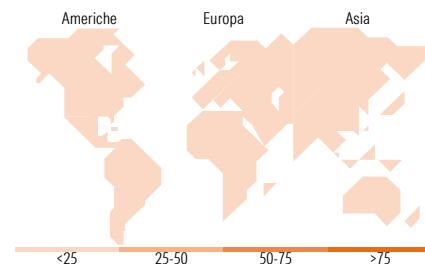


Asset Allocation %	Netta
Azioni	150,09
Obbligazioni	1.693,1
Liquidità	-2.002,71
Altro	259,50

### Fixed Income Style Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi
Alto	Med	
		Basso
		Med
		Alta

Fondo  
Duration Effettiva -  
Maturità effettiva -  
Qualità Credito Media



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Swap Graham Ma-Msdscogq	-	259,50
Euro Bund Future Mar 26	-	60,33
Euro Bobl Future Mar 26	-	60,06
Euro Schatz Future Mar 26	-	59,49
10 Year Treasury Note Future...	-	53,70
T-BOND 30YR FUTURE JUN26	-	37,25
E-mini S&P 500 Future Mar 26	-	35,50
Long Gilt Future June 26	-	34,63
Nikkei 225 Future Mar 26	-	23,84
Future on TOPIX	-	21,76
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		646,06
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		30

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	1.655,64
Societario	48,51
Cartolarizzazioni	3,32
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-2.016,98
Derivati	-0,07

### 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)	10,30 USD	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	2038993400	(01/07/2026)		Investimento Min. Successivo	1 EUR
Web	www.grahamcapital.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,70%
Data di Partenza	17/06/2020	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,44%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	17/06/2020	Inc/Acc	Acc		
NAV (01/07/2026)	USD 12,60	ISIN	LU2183933816		

See disclosures for more details

© 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 produttrici; (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.

# PrivilEdge Graham Quant Macro MA USD Acc

Patrimonio Netto (Mln) 75,70 USD

(28/02/2026)