

# PrivilEdge Graham Quant Macro MA USD Acc

**Categoria Morningstar™**

Category\_EUCA001007

**Benchmark Morningstar**

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

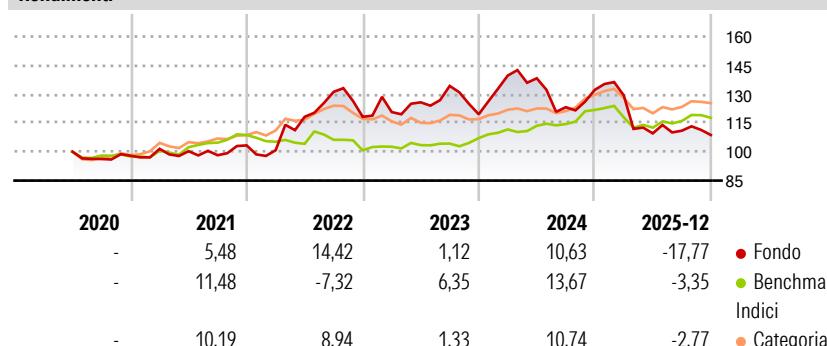
**Benchmark Dichiarato**

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.

**Rendimenti**

**Misure di Rischio**

3Y Alpha	-2,39	3Y Sharpe Ratio	-0,28
3Y Beta	-0,40	3Y Std Dev	15,79
3Y R-Squared	4,51	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,62	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	13,45	10Y Risk	-

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

**Rend. Cumulati %**
**Fondo**
**Bmk**
**Cat**
**Rendimenti Trimestrali %**
**Q1**
**Q2**
**Q3**
**Q4**
**3-Mesi**
**0,80**
**-0,12**
**1,62**
**6-Mesi**
**1,46**
**4,05**
**4,65**
**1-Anno**
**-16,93**
**-3,33**
**-3,60**
**3-Anni Ann.ti**
**-1,10**
**4,88**
**2,81**
**5-Anni Ann.ti**
**2,55**
**3,59**
**4,14**
**10-Anni Ann.ti**
**-**
**-**
**-**

Rendimenti aggiornati al 19/01/2026

**Portafoglio 30/09/2025**

**Asset Allocation %**

- Azioni 119,29
- Obbligazioni 667,33
- Liquidità -686,6
- Altro 0,00

**Netta**

119,29  
667,33  
-686,6  
0,00

**Fixed Income Style**
**Box™**
**Fondo**

Duration Effettiva		
Maturity effettiva		
Qualità Credito Media		
Alto	Med	Basso
Bassa	Med	Alta
Sensibilità ai Tassi		

**Rendimenti**
**Q1**
**Q2**
**Q3**
**Q4**
**Trimestrali %**
**-**
**-**
**-**
**-**
**2026**
**-**
**-**
**-**
**-**
**2025**
**-2,18**
**-15,27**
**1,26**
**-2,01**
**2024**
**16,86**
**-1,02**
**-10,88**
**7,32**
**2023**
**2,10**
**4,20**
**6,79**
**-10,99**
**2022**
**-2,41**
**17,25**
**11,01**
**-9,91**
**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 - Emergenti	-

**Anagrafica**

Società di Gestione	JP Morgan Asset Management (UK) Ltd	Patrimonio Classe (Mln)	16,80 USD	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	+44 20 77424000	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,43%
Web	www.jpmorganassetmana	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,44%
	gement.co.uk	UCITS	Si	Commissione di incentivo	15,00%
Data di Partenza	17/06/2020	Inc/Acc	Acc		
Nome del Gestore	-	ISIN	LU2183933816		
Data Inizio Gestione	17/06/2020				

## PrivilEdge Graham Quant Macro MA USD Acc

NAV (19/01/2026)	USD 11,89
Patrimonio Netto (Mln)	129,94 USD
(30/09/2025)	