

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

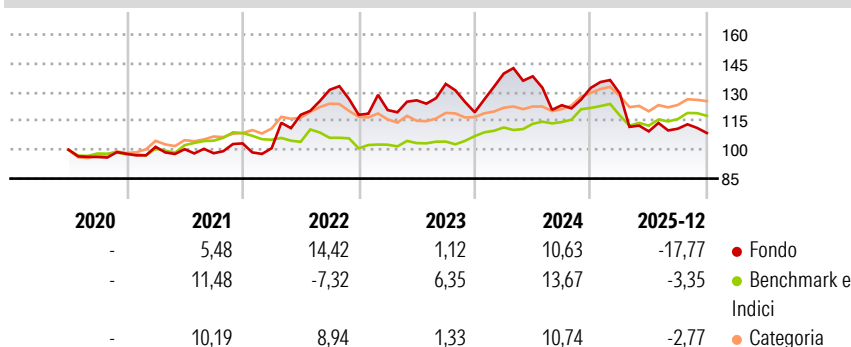
The Sub-Fund is actively managed and is not managed in reference to a benchmark. The Sub-Fund's objective is to achieve long-term investment returns by investing in a directional, long and short strategy that utilizes fundamental and price-based indicators to establish return forecasts across global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

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)

Rendimenti

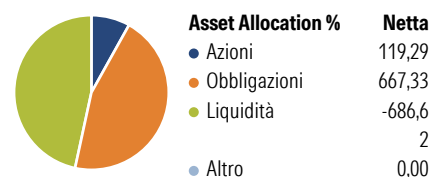


| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|------------------|--------|-------|-------|
| 3-Mesi | 0,80 | -0,12 | 1,62 |
| 6-Mesi | 1,46 | 4,05 | 4,65 |
| 1-Anno | -16,93 | -3,33 | -3,60 |
| 3-Anni Ann.ti | -1,10 | 4,88 | 2,81 |
| 5-Anni Ann.ti | 2,55 | 3,59 | 4,14 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 19/01/2026

| 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 |

Portafoglio 30/09/2025



Fixed Income Style

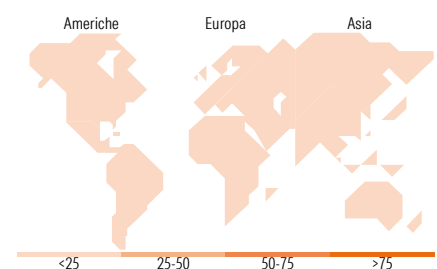
Box™

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |

 Qualità Credito
Alto Med Basso
Sensibilità ai Tassi
Bassa Med Alta

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

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 | (19/01/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.jpmorganassetmanagement.co.uk | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 1,43% |
| 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 | | |
| | | ISIN | LU2183933816 | | |

PrivilEdge Graham Quant Macro MA USD Acc

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