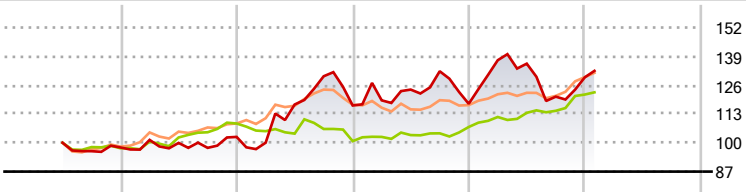
PrivilEdge Graham Quant Macro PA USD Acc

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001007	Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report	Not Benchmarked	★★★

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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-01	
-	4,87	13,82	0,65	10,14	2,27	Fondo
-	11,48	-7,32	6,35	13,67	0,81	Benchmark e Indici
-	10,19	8,94	1,33	10,74	1,50	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	2,72	3Y Sharpe Ratio	0,55
3Y Beta	-0,55	3Y Std Dev	16,27
3Y R-Squared	16,90	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,37	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	15,96	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	11,95	6,68	7,48
6-Mesi	9,51	8,29	9,30
1-Anno	7,56	12,02	11,07
3-Anni Ann.ti	12,10	5,64	7,16
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

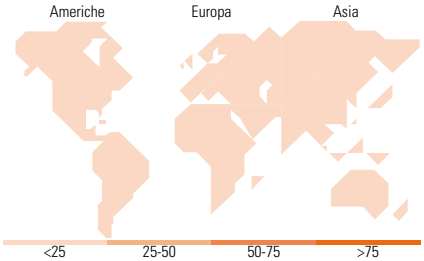
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	16,72	-1,13	-10,97	7,21
2023	1,98	4,07	6,67	-11,10
2022	-2,55	17,23	10,88	-10,14
2021	3,51	-1,35	-2,22	5,04

Portafoglio 31/10/2024

Asset Allocation %	Netta
Azioni	116,96
Obbligazioni	701,70
Liquidità	-718,66
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

Fondo	
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Dax Future Dec 24	—	33,19
Euro Stoxx50 Fut Dec24	—	27,18
Euro Bobl Future Dec 24	—	23,95
Euro Bund Future Dec 24	—	20,77
Ftse 100 Future Dec24	—	20,12
Nikkei 225 Future Dec 24	—	19,19
Long Gilt Future Dec 24	—	17,65
Future on TOPIX	—	14,47
CAC 40 Index Future Nov 24	—	11,00
5 Year Treasury Note Future...	—	7,42
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		194,93
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		55

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	690,88
Societario	13,78
Cartolarizzazioni	0,75
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-580,77
Derivati	-141,62

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
Telefono	+44 20 77424000
Web	www.jpmorganassetmanagement.co.uk
Data di Partenza	17/06/2020
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	17/06/2020

Patrimonio Classe (Mln) (03/02/2025)	0,86 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2183933907

Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,86%
Spese correnti	1,85%
Commissione di incentivo	15,00%

© 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.

PrivilEdge Graham Quant Macro PA USD Acc

NAV (03/02/2025)	USD 12,41
Patrimonio Netto (Mln) (31/10/2024)	215,30 USD

© 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.