

PriviEdge Graham Quant Macro MA CHF Syst Hedged Acc

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001008

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

Senza 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	-	3Y Sharpe Ratio	0,63
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,32
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	6,76
6-Mesi	1,85
1-Anno	-0,76
3-Anni Ann.ti	9,59
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	8,33	-1,58	-5,97	-1,25
2023	2,63	5,44	3,65	-4,34
2022	-3,64	12,73	7,43	-5,28
2021	-2,95	0,31	-3,25	7,40

Portafoglio 31/10/2024


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	116,96
● Obbligazioni	701,70
● Liquidità	-718,6
● Altro	6
	0,00

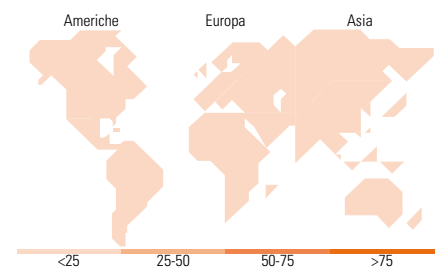
Fixed Income
Style Box™

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

Duration Effettiva
Maturità 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 %

Settore	Fondo
■ Governativo	690,88
■ Societario	13,78
■ Cartolarizzazioni	0,75
■ Enti Locali	0,00
■ Liquidità ed equivalenti	-580,77
■ Derivati	-141,62

Coupon Range %

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 %

Regione	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 Sviluppatisi	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	JP Morgan Asset Management (UK) Ltd	Patrimonio Classe (Mln)	16,96 CHF	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	+44 20 77424000	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.jpmorganassetmanagement.co.uk	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	1,37%
Data di Partenza	17/06/2020	UCITS	Si	Spese correnti	1,32%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	17/06/2020	ISIN	LU2183934384		
NAV (03/02/2025)	CHF 11,38				

PrivilEdge Graham Quant Macro MA CHF Syst Hedged Acc

Patrimonio Netto (Mln) 215,30 USD

(31/10/2024)