

# PriveEdge Graham Quant Macro MA EUR Syst Hedged Acc

## Categoria Morningstar™

Alt - Global Macro

## Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

## Morningstar Rating™

★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

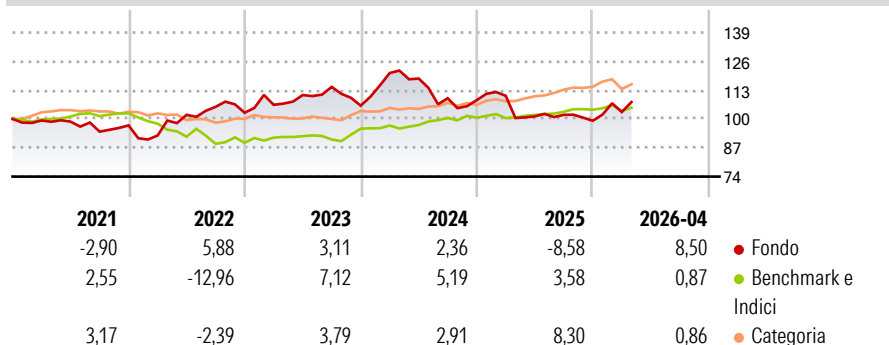
The Sub-Fund is actively managed and is not managed in reference to a benchmark. The Sub-Fund's objective is to achieve long-term investment returns by investing in a directional, long and short strategy that utilizes fundamental and price-based indicators to establish return forecasts across global 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	-2,40	3Y Sharpe Ratio	-0,19
3Y Beta	0,19	3Y Std Dev	11,13
3Y R-Squared	0,52	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,38	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	11,61	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

### Rendimenti



### Rend. Cumulati %

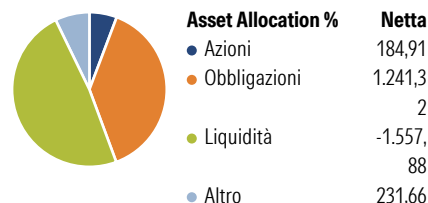
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,32	-0,75	-1,21
6-Mesi	7,63	1,28	2,01
1-Anno	8,67	3,57	7,24
3-Anni Ann.ti	0,94	4,63	4,72
5-Anni Ann.ti	2,23	1,06	1,69
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 15/05/2026

### Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	3,96	-	-	-
2025	1,81	-8,43	0,71	-2,64
2024	13,89	-2,06	-7,52	-0,77
2023	3,48	4,15	3,32	-7,40
2022	-4,70	10,10	3,54	-2,54

### Portafoglio 31/01/2026

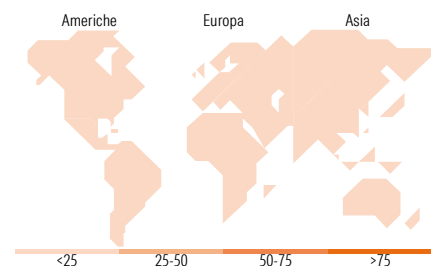


### Fixed Income Style

#### Box™

		Qualità Credito		
		Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa			
	Med			
		Alta		

Fondo  
Duration Effettiva -  
Maturità effettiva -  
Qualità Credito Media



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Swap Graham Ma-Msdscogq	-	231,66
10 Year Treasury Note Future...	-	57,67
Euro Bund Future Mar 26	-	55,89
Euro Schatz Future Mar 26	-	50,52
Future on TOPIX	-	49,35
Euro Bobl Future Mar 26	-	45,59
E-mini Russell 2000 Index...	-	43,59
T-BOND 30YR FUTURE MAR26	-	41,77
Long Gilt Future Mar 26	-	39,09
Hang Seng Index Future Feb 26	-	29,24
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		644,37
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		29

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	1.210,66
Societario	39,70
Cartolarizzazioni	3,19
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-814,11
Derivati	-756,00

### 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)	2,10 EUR	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	2038993400	(15/05/2026)		Investimento Min. Successivo	1 EUR
Web	www.grahamcapital.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	17/06/2020	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,44%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	17/06/2020	Inc/Acc	Acc		
NAV (15/05/2026)	EUR 11,74	ISIN	LU2183934111		

# PrivilEdge Graham Quant Macro MA EUR Syst Hedged Acc

Patrimonio Netto (Mln)

81,47 USD

(31/01/2026)