

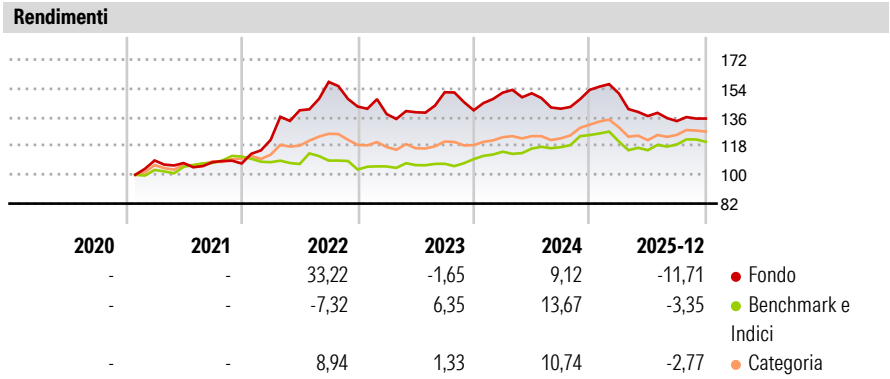
Graham Macro UCITS Fund Class J Platform USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001007	Morningstar US Conservative Target	N/A	★
	Allocation NR USD		
	Usato nel Report		

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Fund's investment objective is to achieve long term capital growth over the long-term. The Investment Manager intends to achieve the Fund's investment objective by gaining long and/or short exposure to four asset classes, namely fixed income, currencies, equities, equity indices and commodities (each an "Asset Class" and collectively the "Asset Classes") listed or traded on a Market. In general, the Fund shall gain exposure to these Asset Classes through various derivative instruments such as futures contracts, and options on futures contracts, forward contracts on currencies, and swaps on fixed income, equities and currencies. The Fund does not have any specific industry, geographic or sector focus.

Misure di Rischio			
3Y Alpha	-2,12	3Y Sharpe Ratio	-0,41
3Y Beta	-0,33	3Y Std Dev	10,28
3Y R-Squared	13,19	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,80	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	9,17	10Y Risk	-
Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)			









Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,49	-0,12	1,62	Trimestrali %				
6-Mesi	-0,66	4,05	4,65	2026	-	-	-	-
1-Anno	-12,35	-3,33	-3,60	2025	-1,45	-9,39	-2,30	1,19
3-Anni Ann.ti	-1,52	4,88	2,81	2024	7,88	-0,26	-6,40	8,35
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2023	-3,31	0,85	8,99	-7,45
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	13,78	15,16	12,64	-9,74

Rendimenti aggiornati al 16/01/2026

Portafoglio -

Asset Allocation %	Netta	Fixed Income Style	Fondo	
		Box™	Duration Effettiva	-
			Maturità effettiva	-
			Qualità Credito Media	
		Qualità Credito		
		Alto		
		Med		
		Basso		
		Sensibilità ai Tassi		
		Bassa		
		Med		
		Alta		

Titoli principali			Fixed Income Sector Weightings %		Fondo	Ripartizione Geografica %		Fondo
Nome	Settore	%	 Governativo		0,00	America		0,00
			 Societario		0,00	Stati Uniti		-
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		0,00	 Cartolarizzazioni		0,00	Canada		-
Numero Complessivo di Titoli Azionari		-	 Enti Locali		0,00	America Latina e Centrale		-
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		-	 Liquidità ed equivalenti		0,00			
			 Derivati		0,00	Europa		0,00
			Coupon Range %		Fondo	Regno Unito		-
			0 coupon		0,00	Europa Occidentale - Euro		-
			Da 0 a 4 cedole		0,00	Europa Occidentale - Non Euro		-
			Da 4 a 6 cedole		0,00	Europa dell'Est		-
			Da 6 a 8 cedole		0,00	Africa		-
			Da 8 a 10 cedole		0,00	Medio Oriente		-
			Da 10 a 12 cedole		0,00			
			Oltre 12 cedole		0,00	Asia		0,00
						Giappone		-
						Australasia		-
						Asia - Paesi Sviluppati		-
						Asia - Emergente		-

Anagrafica

Società di Gestione	Graham Capital Management LP	Patrimonio Classe (Mln)	242,13 USD	Investimento Min. Ingresso	75.000.000 USD
Telefono	2038993400	(15/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.grahamcapital.com	Domicilio	IRLANDA	T.E.R.	2,14%
Data di Partenza	27/01/2021	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	2,14%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	15/01/2018	Inc/Acc	Acc		
		ISIN	IE00BNGJH440		

Graham Macro UCITS Fund Class J Platform USD

NAV ^(16/01/2026)	USD 130,69
Patrimonio Netto (Mln)	-