

Premium Funds SICAV - Multi Alternative Risk Premia Fund 2X EUR Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

No benchmark

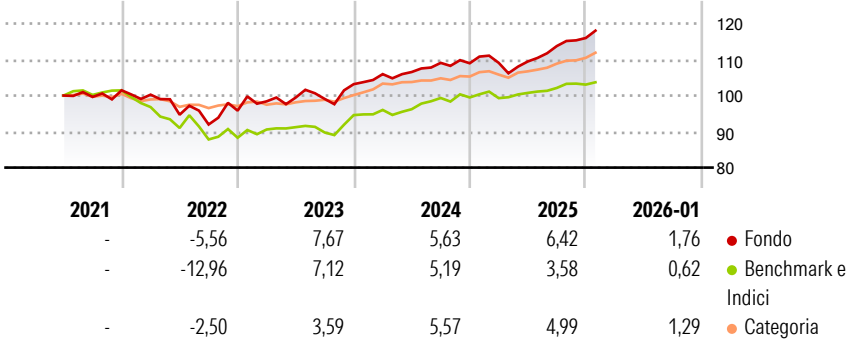
Morningstar Rating™

★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of this Sub-fund is to achieve long-term capital appreciation investing in a systematic way in globally diversified multi asset risk premia, while maintaining the Sub-fund around an objective of annual volatility with a target around 6%.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	1,11	3Y Sharpe Ratio	0,55
3Y Beta	0,99	3Y Std Dev	5,00
3Y R-Squared	58,66	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,34	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	3,22	10Y Risk	-

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

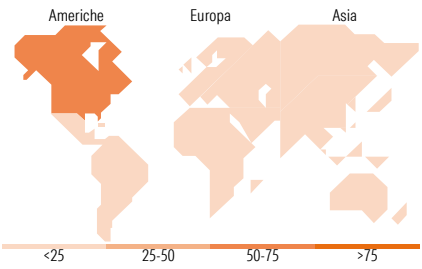
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,25	0,74	2,84	2026	-	-	-	-
6-Mesi	7,42	2,95	5,61	2025	0,10	0,35	3,90	1,97
1-Anno	6,94	3,82	6,05	2024	2,71	0,55	2,38	-0,10
3-Anni Ann.ti	6,48	4,90	5,48	2023	2,70	1,06	-0,37	4,13
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-1,19	-5,55	-2,87	4,18
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	2,32
Maturity effettiva	0,90
Qualità Credito Media	A
Qualità Credito	
Alto	
Med	
Basso	
Sensibilità ai Tassi	
Bassa	
Med	
Alta	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Citigroup Global Markets...	—	5,19
Natixis S.A. 0%	—	4,37
Natixis S.A. 0%	—	4,02
Bank of Ireland Group PLC...	—	2,49
iShares JP Morgan \$ EM Bond...	—	2,03
UBS Group AG 1%	—	1,92
Italy (Republic Of) 0%	—	1,91
Italy (Republic Of) 0%	—	1,90
Theam Quant Dynamic Volat...	—	1,85
Alpha UCITS SICAV FairOaks...	—	1,74
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		27,43
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		80

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	19,46
Societario	54,34
Cartolarizzazioni	1,87
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	23,17
Derivati	1,16
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	31,81
Da 0 a 4 cedole	57,49
Da 4 a 6 cedole	9,05
Da 6 a 8 cedole	1,26
Da 8 a 10 cedole	0,38
Da 10 a 12 cedole	0,01
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	78,68
Stati Uniti	69,33
Canada	0,01
America Latina e Centrale	9,35
Europa	1,27
Regno Unito	0,01
Europa Occidentale - Euro	1,23
Europa Occidentale - Non Euro	0,02
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	20,05
Giappone	0,18
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	1,32
Asia - Emergente	18,55

Anagrafica

Società di Gestione	Generali Asset Management S.p.A. Società di gestione del risparmio	Patrimonio Classe (Mln)	7,23 EUR	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
		(11/02/2026)		Investimento Min. Successivo	1.000.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	www.generali-investments.de	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,78%
		UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
		Inc/Acc	Acc		
Data di Partenza	24/06/2021	ISIN	LU2036692593		
Nome del Gestore	-				
Data Inizio Gestione	29/11/2019				
NAV (11/02/2026)	EUR 119,47				

Premium Funds SICAV - Multi Alternative Risk Premia Fund 2X EUR Acc

Patrimonio Netto (Mln)	517,68 EUR
(31/12/2025)	