

# Generali Multi Portfolio Solutions SICAV - Multi Alternative Risk Premia Fund

Categoria Morningstar™  
2X EUR Acc

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Benchmark Dichiarato

No benchmark

Morningstar Rating™

★★★

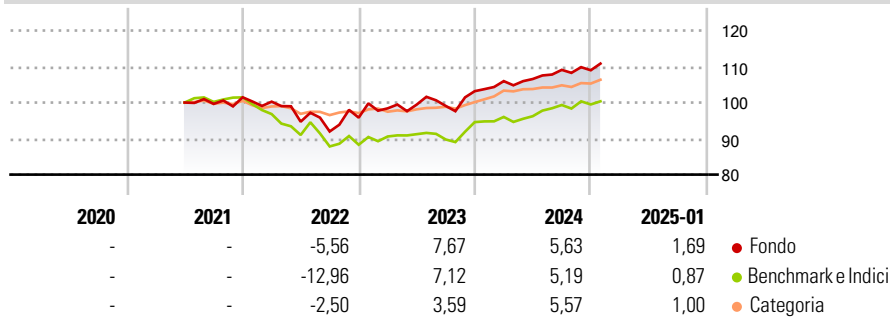
Allocation NR EUR

Usato nel Report

## 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

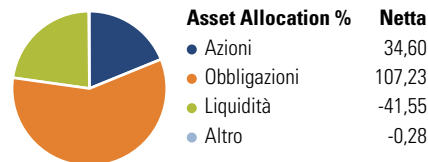
3Y Alpha	3,01	3Y Sharpe Ratio	0,18
3Y Beta	0,95	3Y Std Dev	7,08
3Y R-Squared	73,10	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,86	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	3,64	10Y Risk	-

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	2,25	2,13	2,07	2025	-	-	-	-
6-Mesi	4,23	2,92	2,82	2024	2,71	0,55	2,38	-0,10
1-Anno	6,31	6,10	5,95	2023	2,70	1,06	-0,37	4,13
3-Anni Ann.ti	3,48	0,70	2,84	2022	-1,19	-5,55	-2,87	4,18
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	-0,38	1,84
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

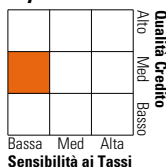
Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

## Portafoglio 31/12/2024

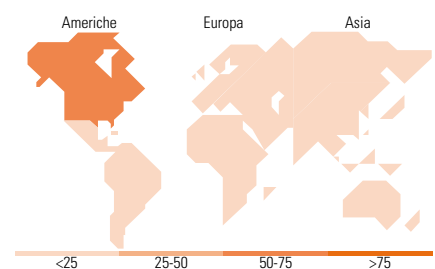


## Fixed Income

### Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	1,62
Maturity effettiva	1,01
Qualità Credito Media	A



## Titoli principali

Nome	Settore	%
Italy (Republic Of) 0%	—	7,94
France (Republic Of) 0%	—	5,98
E-mini S&P 500 Future Mar 25	—	5,07
Citigroup Global Markets...	—	4,96
ASX SPI 200 Index Future Mar...	—	4,19
Euro Stoxx 50 Mar25	—	4,02
Natixis S.A. 0%	—	3,87
France (Republic Of) 1%	—	3,76
S&P TSX 60 Index Future Mar 25	—	3,61
Theam Quant Dynamic Volat...	—	3,50
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		46,91
Numero Complessivo di Titoli Azionari		2
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		89

## Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	78,30
Societario	47,26
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-73,73
Derivati	48,17

## Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	32,65
Da 0 a 4 cedole	58,37
Da 4 a 6 cedole	8,00
Da 6 a 8 cedole	0,84
Da 8 a 10 cedole	0,12
Da 10 a 12 cedole	0,01
Oltre 12 cedole	0,00

## Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>71,05</b>
Stati Uniti	55,51
Canada	14,61
America Latina e Centrale	0,93
<b>Europa</b>	<b>2,08</b>
Regno Unito	0,16
Europa Occidentale - Euro	0,31
Europa Occidentale - Non Euro	0,07
Europa dell'Est	0,25
Africa	0,37
Medio Oriente	0,92
<b>Asia</b>	<b>26,87</b>
Giappone	0,00
Australasia	16,34
Asia - Paesi Sviluppati	3,78
Asia - Emergente	6,75

## Anagrafica

Società di Gestione	Generali Investments Luxembourg SA	Patrimonio Classe (Mln)	13,33 EUR	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Telefono	35 228 373 728	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.generali-investments.lu	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	24/06/2021	UCITS	Si	Spese correnti	0,78%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	29/11/2019	ISIN	LU2036692593		
NAV (03/02/2025)	EUR 111,02				
Patrimonio Netto (Mln)	500,26 EUR				

(31/12/2024)

© 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 prodotte; (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.

MORNINGSTAR®