Generali Multi Portfolio Solutions SICAV - Multi Alternative Risk Premia Fund 2X EUR

Categoria Morningstar™
Acc
Multistrategy

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

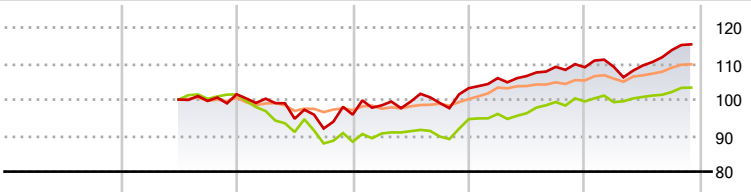
Benchmark Dichiarato
No benchmark

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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-11	
-	-	-5,56	7,67	5,63	5,83	Fondo
-	-	-12,96	7,12	5,19	3,85	Benchmark e Indici
-	-	-2,50	3,59	5,57	4,26	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,10	3Y Sharpe Ratio	0,47
3Y Beta	1,04	3Y Std Dev	5,61
3Y R-Squared	65,95	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,35	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	3,28	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,13	1,28	2,37
6-Mesi	6,33	2,70	3,20
1-Anno	4,67	2,28	4,22
3-Anni Ann.ti	5,51	4,30	4,74
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 04/12/2025

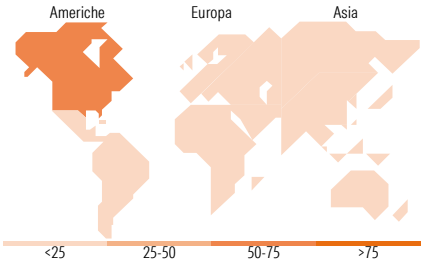
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	0,10	0,35	3,90	-
2024	2,71	0,55	2,38	-0,10
2023	2,70	1,06	-0,37	4,13
2022	-1,19	-5,55	-2,87	4,18
2021	-	-	-0,38	1,84

Portafoglio 31/10/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	31,78
Obbligazioni	94,65
Liquidità	-26,95
Altro	0,51

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	2,23
Maturity effettiva	0,90
Qualità Credito Media	A



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini S&P 500 Future Dec 25	—	9,70
Citigroup Global Markets...	—	5,29
Merrill Lynch B.V. 0.76%	—	4,86
Natixis S.A. 0%	—	4,15
Natixis S.A. 0%	—	3,95
MSCI Emerging Markets Index...	—	3,19
E-mini Nasdaq 100 Future Dec...	—	3,04
S&P TSX 60 Index Future Dec 25	—	2,59
ASX SPI 200 Index Future Dec...	—	2,28
Ftse 100 Idx Fut Dec25	—	2,21
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		41,24
Numero Complessivo di Titoli Azionari		3
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		69

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	25,99
Societario	70,29
Cartolarizzazioni	2,43
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-43,77
Derivati	45,06

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	30,99
Da 0 a 4 cedole	59,16
Da 4 a 6 cedole	8,15
Da 6 a 8 cedole	1,28
Da 8 a 10 cedole	0,41
Da 10 a 12 cedole	0,01
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	**76,10**
Stati Uniti	65,24
Canada	8,21
America Latina e Centrale	2,65
Europa	**5,76**
Regno Unito	0,09
Europa Occidentale - Euro	4,40
Europa Occidentale - Non Euro	0,15
Europa dell'Est	0,19
Africa	0,33
Medio Oriente	0,60
Asia	**18,13**
Giappone	0,03
Australasia	6,85
Asia - Paesi Sviluppati	3,57
Asia - Emergente	7,69

Anagrafica

Società di Gestione	Generali Investments Luxembourg SA
Telefono	35 228 373 728
Web	www.generali-investments.lu
Data di Partenza	24/06/2021
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	29/11/2019
NAV (04/12/2025)	EUR 115,69
Patrimonio Classe (MIn) (04/12/2025)	7,16 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2036692593
Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	1.000.000 EUR
T.E.R.	-
Spese correnti	0,78%
Commissione di incentivo	20,00%

© 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 prodotto; (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.

Generali Multi Portfolio Solutions SICAV - Multi Alternative Risk Premia Fund 2X EUR

Patrimonio Netto (Mln) 512,32 EUR

Acc

© 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 prodotto; (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.