

RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity DH USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001004

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

No benchmark

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

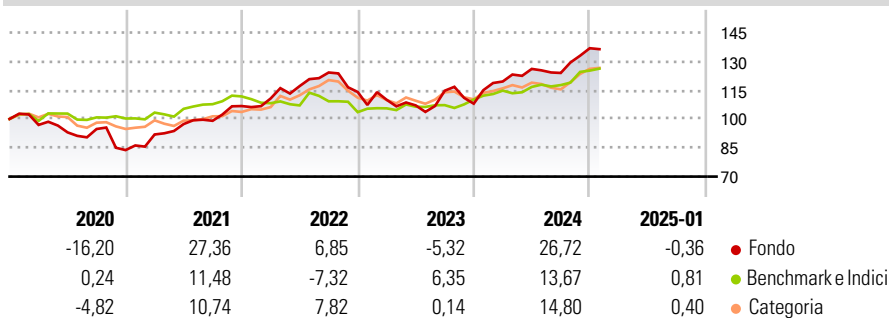
Ricerca di un apprezzamento del capitale a medio-lungo termine. Mediante l'utilizzo di strategie di copertura, il comparto neutralizza totalmente o parzialmente l'esposizione ai rischi direzionali dei mercati azionari europei. Il comparto investe una quota minima del 75% in azioni di società aventi sede in uno Stato membro dell'Unione europea e in Norvegia. L'esposizione "long" ai mercati azionari può oscillare tra il 75% e il 130%. L'esposizione "short" può invece variare tra lo 0% e il 130%. Il gestore può utilizzare strumenti derivati a titolo di copertura o per ottimizzare l'esposizione del portafoglio. Il comparto potrà investire fino al 10% del suo patrimonio netto in quote di OICVM o di altri OIC.

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,00	3Y Sharpe Ratio	0,57
3Y Beta	-0,37	3Y Std Dev	11,82
3Y R-Squared	20,45	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,32	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	12,55	10Y Risk	Alto

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	6,64	6,68	7,73
6-Mesi	11,95	8,29	10,28
1-Anno	19,13	12,02	13,46
3-Anni Ann.ti	9,62	5,64	11,11
5-Anni Ann.ti	5,97	4,17	8,11
10-Anni Ann.ti	4,82	4,81	5,51

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	10,68	5,49	-1,68	10,39
2023	-3,57	-2,63	7,13	-5,87
2022	3,68	5,85	6,03	-8,17
2021	9,69	5,91	1,74	7,76

Portafoglio 30/09/2024



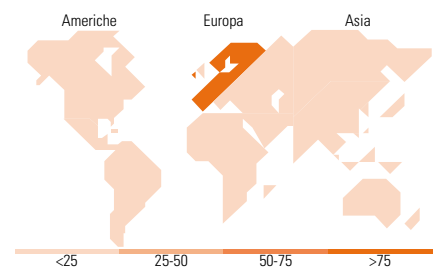
Asset Allocation %	Netta
Azioni	7,66
Obbligazioni	0,00
Liquidità	92,34
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Henkel AG & Co KGaA...	🏭	1,95
Rockwool AS Class B	🏠	1,88
OMV AG	🚗	1,72
Unipol Gruppo SpA...	🏠	1,65
Merck KGaA	🏠	1,62
Evonik Industries AG	🏠	1,59
Essity AB Class B	🏠	1,58
NKT AS	🏠	1,57
Deutsche Boerse AG	🏠	1,54
Wolters Kluwer NV	🏠	1,50
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		16,61
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.096
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo	Fondo
🏠 Governativo	0,00
🏠 Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏠 Enti Locali	0,00
🏠 Liquidità ed equivalenti	100,00
🏠 Derivati	0,00

Coupon Range %

Fondo	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	Fondo
America	0,58
Stati Uniti	0,58
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	99,08
Regno Unito	19,97
Europa Occidentale - Euro	50,62
Europa Occidentale - Non Euro	27,89
Europa dell'Est	0,34
Africa	0,22
Medio Oriente	0,04
Asia	0,34
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,34
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	RAM Active Investments SA	Patrimonio Classe (Mln)	8,54 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+41 58 726 8700	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.ram-ai.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	2,71%
Data di Partenza	16/12/2011	UCITS	Si	Spese correnti	2,65%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	15/12/2011	ISIN	LU0705071610		
NAV (03/02/2025)	USD 189,26				

RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity DH USD

Patrimonio Netto (Mln) 147,11 EUR

(30/09/2024)