

RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity UH GBP

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001020

Benchmark Morningstar

Morningstar UK Cautious Target Allocation

NR GBP

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

No benchmark

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

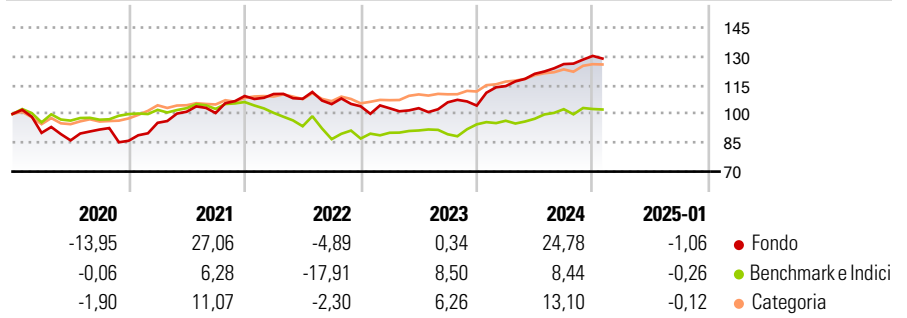
Ricerca di un apprezzamento del capitale a medio-lungo termine. Mediante l'utilizzo di strategie di copertura, il comparto neutralizza totalmente o parzialmente l'esposizione ai rischi direzionali dei mercati azionari europei. Il comparto investe una quota minima del 75% in azioni di società aventi sede 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	0,63	3Y Sharpe Ratio	0,51
3Y Beta	-0,43	3Y Std Dev	7,83
3Y R-Squared	16,38	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,63	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	10,73	10Y Risk	Alto

Basati su Morningstar UK Cautious Target Allocation NR GBP (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	2,42	2,59	3,81
6-Mesi	8,76	3,90	6,81
1-Anno	17,15	7,77	11,84
3-Anni Ann.ti	6,48	0,19	7,95
5-Anni Ann.ti	5,14	0,24	7,16
10-Anni Ann.ti	2,71	0,68	3,16

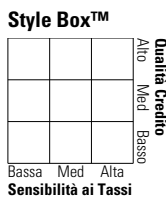
Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	9,73	5,60	4,19	3,37
2023	-1,01	0,06	2,97	-1,62
2022	0,95	-2,26	-2,55	-1,08
2021	10,87	6,03	-0,66	8,80

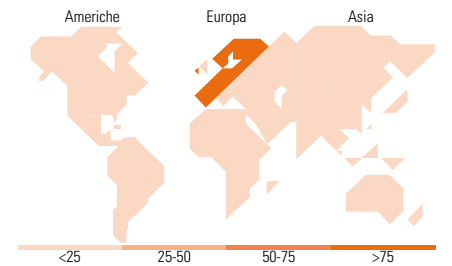
Portafoglio 30/09/2024



Fixed Income Style Box™



Fondo
Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media



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

Coupon Range %	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
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 Sviluppatti	0,34
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	RAM Active Investments SA	Patrimonio Classe (Mln)	1,33 GBP	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+41 58 726 8700	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.ram-ai.com	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	2,31%
Data di Partenza	08/12/2014	UCITS	Si	Spese correnti	2,26%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	15/12/2011	ISIN	LU0935266949		
NAV (03/02/2025)	GBP 188,07				



RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity UH GBP

Patrimonio Netto (Mln) 147,11 EUR

(30/09/2024)