

Ellipsis Optimal Allocation - Credit RCHF

Categoria Morningstar™

Global Flexible - CHF Covered

Benchmark Morningstar

Morningstar Global Core Bond GR Hedged

CHF

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

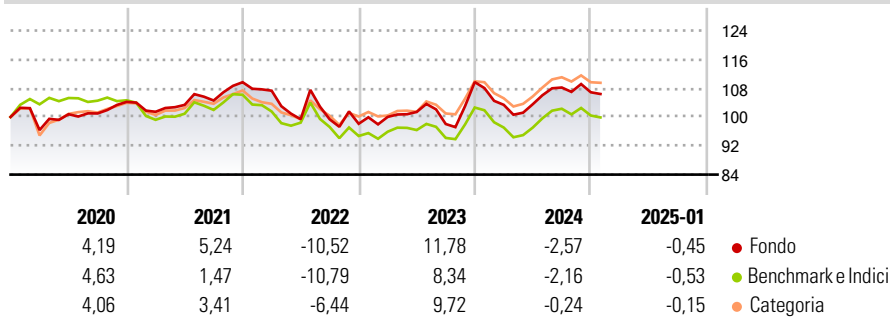
Bloomberg Global Agg Corp TR Hdg EUR

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Rendimenti



Misure di Rischio

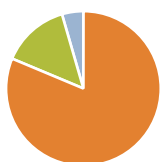
3Y Alpha	2,40	3Y Sharpe Ratio	-0,22
3Y Beta	1,30	3Y Std Dev	10,39
3Y R-Squared	88,94	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,21	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	3,29	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Global Core Bond GR Hedged CHF (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,46	-0,14	0,14	2025	-	-	-	-
6-Mesi	-1,29	-1,69	-0,77	2024	-5,75	0,15	4,49	-1,22
1-Anno	-0,56	-0,79	-0,06	2023	1,93	1,38	-3,30	11,86
3-Anni Ann.ti	-0,01	-0,17	1,43	2022	-2,15	-7,38	-0,03	-1,24
5-Anni Ann.ti	0,80	-0,49	1,06	2021	-2,64	1,89	1,17	4,86
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

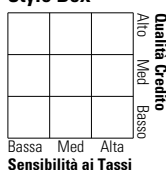
Portafoglio 31/08/2024



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,02
Obbligazioni	81,29
Liquidità	14,21
Altro	4,48

Fixed Income

Style Box™



Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-

Fondo

Credit Quality % Fond Credit Quality % Fond

0	0
---	---

Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Notes...	—	26,21
France (Republic Of) 0%	—	11,90
Germany (Federal Republic...	—	9,77
Ellipsis High Yield Fund Z	—	9,51
Germany (Federal Republic...	—	5,61
United Kingdom of Great...	—	5,10
United States Treasury Bonds...	—	4,15
Germany (Federal Republic...	—	3,82
Worldline SA 0%	—	1,91
HelloFresh SE 0.75%	—	1,86
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		79,84
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		42

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo	Fondo
Governativo	67,31
Societario	35,99
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-3,16
Derivati	-0,14
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	2,23
Da 0 a 4 cedole	61,35
Da 4 a 6 cedole	17,17
Da 6 a 8 cedole	16,22
Da 8 a 10 cedole	2,96
Da 10 a 12 cedole	0,08
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %

Fondo	Fondo
da 1 a 3	2,69
da 3 a 5	22,61
da 5 a 7	7,86
da 7 a 10	41,95
da 10 a 15	5,94
da 15 a 20	0,00
da 20 a 30	4,83
oltre 30	9,43

Anagrafica

Società di Gestione	Ellipsis Asset Management	Patrimonio Classe (Mln)	58,50 CHF	Investimento Min. Ingresso	10.000.000 CHF
Telefono	-	(03/02/2025)		Investimento Min. Successivo	1/1.000 Quota
Web	www.ellipsis-am.com	Domicilio	FRANCIA	T.E.R.	-
Data di Partenza	19/05/2015	Valuta del Fondo	CHF	Spese correnti	0,23%
Nome del Gestore	Nicolas Blanc	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	14/07/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (03/02/2025)	CHF 99.601,75	ISIN	FR0012686244		
Patrimonio Netto (Mln)	79,15 EUR				

(31/08/2024)