

RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity U EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Azionario Market Neutral

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

No benchmark

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

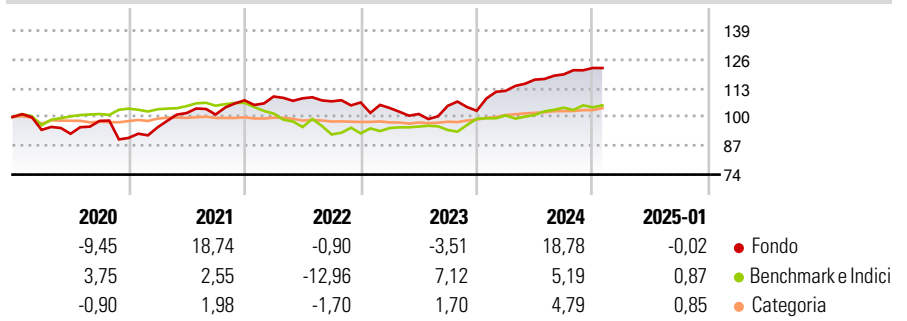
Ricerca di un apprezzamento del capitale a medio-lungo termine. Mediante l'utilizzo di strategie di copertura, il comparto neutralizza totalmente o parzialmente l'esposizione ai rischi direzionali dei mercati azionari europei. Il comparto investe una quota minima del 75% in azioni di società aventi sede 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	2,00	3Y Sharpe Ratio	0,41
3Y Beta	-0,44	3Y Std Dev	7,00
3Y R-Squared	15,73	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,43	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	11,06	10Y Risk	-

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

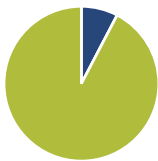
Termine	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,34	2,13	2,25
6-Mesi	5,45	2,92	3,93
1-Anno	12,96	6,10	7,15
3-Anni Ann.ti	5,00	0,70	5,49
5-Anni Ann.ti	3,84	0,78	5,66
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti Trimestrali %

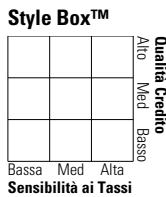
Trimestre	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	8,77	4,49	2,04	2,42
2023	-2,34	-2,61	3,63	-2,11
2022	1,60	-0,75	-1,26	-0,47
2021	5,28	6,75	-0,66	6,35

Portafoglio 30/09/2024

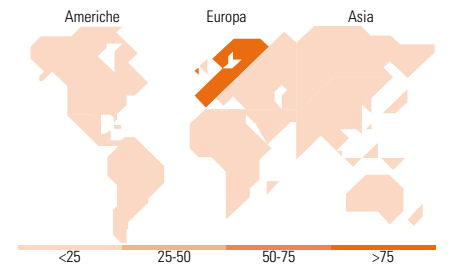


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	7,66
● Obbligazioni	0,00
● Liquidità	92,34
● Altro	0,00

Fixed Income Style Box™



Fondo
Duration Effettiva -
Maturity effettiva -
Qualità Credito Media



Titoli principali

Nome	Settore	%
Henkel AG & Co KGaA...	IT	1,95
Rockwool AS Class B	IT	1,88
OMV AG	IT	1,72
Unipol Gruppo SpA...	IT	1,65
Merck KGaA	IT	1,62
Evonik Industries AG	IT	1,59
Essity AB Class B	IT	1,58
NKT AS	IT	1,57
Deutsche Boerse AG	IT	1,54
Wolters Kluwer NV	IT	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)	0,06 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+41 58 726 8700	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.ram-ai.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	2,29%
Data di Partenza	21/12/2015	UCITS	Si	Spese correnti	2,19%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	15/12/2011	ISIN	LU0935266782		
NAV (03/02/2025)	EUR 173,69				

© 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 produttrici; (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.

RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity U EUR

Patrimonio Netto (Mln) 147,11 EUR

(30/09/2024)