

# Ellipsis Optimal Solutions Liquid Alternative ID EUR

## Categoria Morningstar™

Alt - Long/Short Azionario Europa

## Benchmark Morningstar

Morningstar Developed Europe Target

Market Exposure NR EUR

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

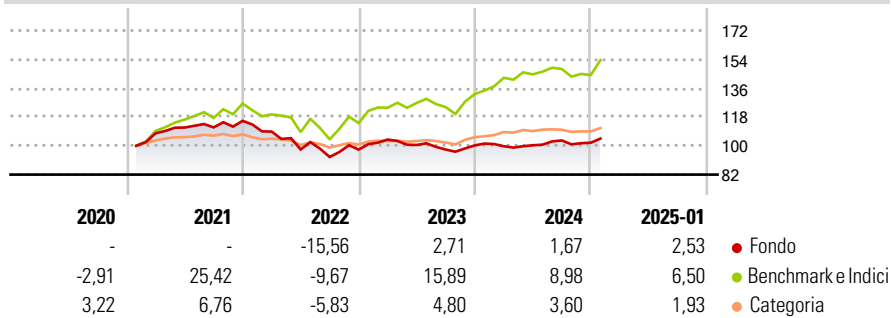
ESTR + 1%

## Morningstar Rating™

★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

### Rendimenti



### Misure di Rischio

|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -8,32 | 3Y Sharpe Ratio | -0,51 |
| 3Y Beta           | 0,60  | 3Y Std Dev      | 9,16  |
| 3Y R-Squared      | 77,35 | 3Y Risk         | +Med  |
| 3Y Info Ratio     | -1,55 | 5Y Risk         | -     |
| 3Y Tracking Error | 6,82  | 10Y Risk        | -     |

Basati su Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat  | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2     | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|-------|------|--------------------------|-------|--------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 3,50  | 5,80  | 1,27 | 2025                     | -     | -      | -     | -     |
| 6-Mesi           | 3,95  | 8,48  | 1,09 | 2024                     | -0,53 | 0,60   | 3,00  | -1,35 |
| 1-Anno           | 3,37  | 13,85 | 7,12 | 2023                     | 6,46  | -3,28  | -2,84 | 2,67  |
| 3-Anni Ann.ti    | -2,52 | 8,17  | 2,77 | 2022                     | -5,80 | -10,27 | -4,84 | 4,99  |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | 7,90  | 5,48 | 2021                     | -     | 3,29   | 0,11  | 3,66  |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -     | -    |                          |       |        |       |       |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

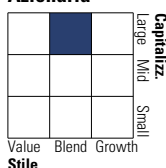
### Portafoglio 31/08/2024



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| Azioni             | 52,45 |
| Obbligazioni       | 43,12 |
| Liquidità          | 4,29  |
| Altro              | 0,14  |

### Style Box

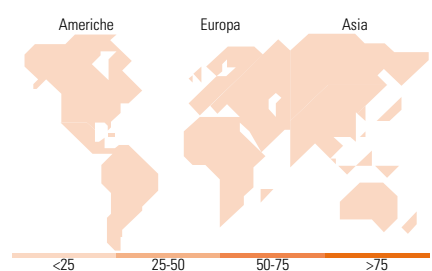
#### Azionaria



### Mkt Cap %

Capitalizzazione media di mercato  
Ave Mkt Cap EUR

### Fondo

Fondo  
285.355,25

### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Call Sx5e 1000 E 09/20/2024...              | -       | 35,48 |
| Option on S&P 500 PR                        | -       | 9,96  |
| Tabula EUR IG Bd Prs-Algn...                | -       | 9,39  |
| Put Sx5e 6000 E 09/20/2024...               | -       | 9,19  |
| Nestle Finance International...             | -       | 6,88  |
| L'Oreal S.A. 0.875%                         | -       | 6,72  |
| ASML Holding N.V. 1.625%                    | -       | 4,60  |
| LVMH Moet Hennessy Vuitton...               | -       | 4,36  |
| AstraZeneca PLC 1.25%                       | -       | 4,22  |
| Richemont International...                  | -       | 3,34  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 94,14 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 3     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 8     |

### Distribuzione Settoriale %

| Distribuzione Settoriale %  | Fondo       |
|-----------------------------|-------------|
| <b>Ciclico</b>              | <b>0,00</b> |
| Materie Prime               | -           |
| Beni di Consumo Ciclici     | -           |
| Finanza                     | -           |
| Immobiliare                 | -           |
| <b>Sensibile</b>            | <b>0,00</b> |
| Telecomunicazioni           | -           |
| Energia                     | -           |
| Beni Industriali            | -           |
| Tecnologia                  | -           |
| <b>Difensivo</b>            | <b>0,00</b> |
| Beni Difensivi              | -           |
| Salute                      | -           |
| Servizi di Pubblica Utilità | -           |

### Ripartizione Geografica %

| Ripartizione Geografica %     | Fondo       |
|-------------------------------|-------------|
| <b>America</b>                | <b>0,00</b> |
| Stati Uniti                   | -           |
| Canada                        | -           |
| America Latina e Centrale     | -           |
| <b>Europa</b>                 | <b>0,00</b> |
| Regno Unito                   | -           |
| Europa Occidentale - Euro     | -           |
| Europa Occidentale - Non Euro | -           |
| Europa dell'Est               | -           |
| Africa                        | -           |
| Medio Oriente                 | -           |
| <b>Asia</b>                   | <b>0,00</b> |
| Giappone                      | -           |
| Australasia                   | -           |
| Asia - Paesi Sviluppatti      | -           |
| Asia - Emergente              | -           |

### Anagrafica

|                        |                           |                         |              |                              |               |
|------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione    | Ellipsis Asset Management | Patrimonio Classe (Mln) | 5,03 EUR     | Investimento Min. Ingresso   | 1.000.000 EUR |
| Telefono               | -                         | (03/02/2025)            |              | Investimento Min. Successivo | 1/1.000 Quota |
| Web                    | www.ellipsis-am.com       | Domicilio               | FRANCIA      | T.E.R.                       | -             |
| Data di Partenza       | 20/06/2017                | Valuta del Fondo        | EUR          | Spese correnti               | 0,67%         |
| Nome del Gestore       | -                         | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | 15,00%        |
| Data Inizio Gestione   | 28/06/2021                | Inc/Acc                 | Acc          |                              |               |
| NAV (03/02/2025)       | EUR 10.354,21             | ISIN                    | FR0013197993 |                              |               |
| Patrimonio Netto (Mln) | 35,96 EUR                 |                         |              |                              |               |

(31/08/2024)