## **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**



Misure di Rischi	0		
3Y Alpha	-5,44	3Y Sharpe Ratio	-0,01
3Y Beta	0,48	3Y Std Dev	6,01
3Y R-Squared	67,13	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,84	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	6,45	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Deve	loped Europ	e Target Market Exposure Ni	R EUR (dove

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,25	7,60	3,24	Trimestrali %				
6-Mesi	2,14	8,03	4,03	2025	0,89	-0,99	1,19	-
1-Anno	3,28	15,12	4,06	2024	-0,53	0,60	3,00	-1,35
3-Anni Ann.ti	2,74	14,88	4,44	2023	6,46	-3,28	-2,84	2,67
5-Anni Ann.ti	-	13,16	2,24	2022	-5,80	-10,27	-4,84	4,99
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 31/10/2	- 2025	-	-	2021	-	3,29	0,11	3,66

## Portafoglio 28/02/2025





Mkt Cap %	Fondo		
Capitalizzazione	Fondo		
media di mercato			
Ave Mkt Cap EUR	352.628,		
	02		



Titoli principali		
Nome	Settore	%
Call Sx5e 1000 E 03/21/2025	_	21,56
Ellipsis Optimal Sltns- Alt	_	9,97
L'Oreal S.A. 0.875%	_	5,43
Kering S.A. 3.625%	_	4,58
Novartis Finance SA 1.125%	_	4,30
ASML Holding N.V. 1.625%	_	3,72
LVMH Moet Hennessy Louis	_	3,44
AstraZeneca PLC 1.25%	_	3,42
Richemont International	_	3,28
Nestle Finance International	_	2,99
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		62,69
Numero Complessivo di Titoli Aziona	ri	27
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	11

Fondo
0,00
-
-
-
-
0,00
-
-
-
-
0,00
-
-
-

<b>&lt;</b> 25	25-50	50-75	>15
Ripartizione	Geografica %	ı	Fondo
America			0,00
Stati Uniti			=
Canada			-
America Latir	na e Centrale		-
Europa			0,00
Regno Unito			-
Europa Occid	entale - Euro		-
Europa Occid	entale - Non E	uro	-
Europa dell'E	st		-
Africa			=
Medio Orient	e		-
Asia			0,00
Giappone			-
Australasia			-
Asia - Paesi S	viluppati		-
Asia - Emerge	ente		-

Anagrafica	
Società di Gestione	Ellipsis Asset Management
Telefono	-
Web	www.ellipsis-am.com
Data di Partenza	20/06/2017
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	28/06/2021
NAV (31/10/2025)	EUR 10.332,51
Patrimonio Netto (MIn)	45,39 EUR
(28/02/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	2,95 EUR
Domicilio	FRANCIA
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	FR0013197993

Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	1/1.000 Quota
T.E.R.	-
Spese correnti	0,67%
Commissione di incentivo	15,00%