

RAM (Lux) Systematic Funds - Global Market Neutral Equity IH CHF

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001005

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

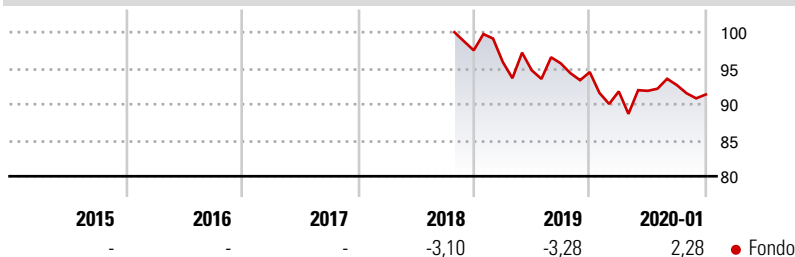
Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective of the sub-fund is to seek capital growth in the medium to long term via a diversified and sustainable long/short equity portfolio incorporating environmental, social and governance (ESG) criteria, while partially or fully limiting exposure to the directional risk of the equity markets through the use of hedging strategies. Investors' attention is drawn to the fact that the management style follows a systematic and disciplined selection and investment process.

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

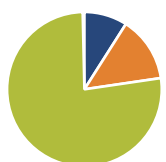
Rendimenti

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	3,73
6-Mesi	1,41
1-Anno	1,66
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 28/01/2020

Rendimenti

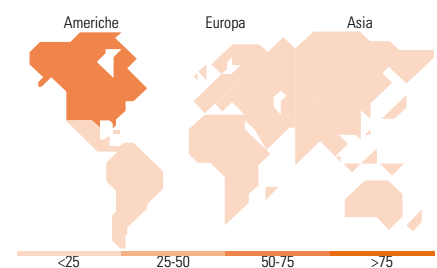
Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

Portafoglio 30/09/2024


Asset Allocation %	Netta
Azioni	9,08
Obbligazioni	13,76
Liquidità	77,52
Altro	-0,36

Fixed Income
Style Box™


Caratteristica	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-


Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Notes...	-	13,76
Genmab AS ADR	+	1,92
Cboe Spx Volatility Index...	-	1,91
CFD on Ferguson Enterprises...	-	1,55
Genmab AS	+	1,41
Cboe Spx Volatility Index...	-	1,11
CFD on The Interpublic Group...	-	1,07
Chow Tai Fook Jewellery...	+	1,00
CFD on Lennar Corp Class A	-	0,98
Cboe Spx Volatility Index...	-	0,92
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		25,64
Numero Complessivo di Titoli Azionari		674
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		1

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	15,08
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	84,92
Derivati	0,00

Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	100,00
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 %

Regione	Fondo
America	50,59
Stati Uniti	46,92
Canada	3,67
America Latina e Centrale	0,00
Europa	25,43
Regno Unito	5,21
Europa Occidentale - Euro	9,25
Europa Occidentale - Non Euro	10,00
Europa dell'Est	0,62
Africa	0,00
Medio Oriente	0,35
Asia	23,98
Giappone	10,32
Australasia	2,61
Asia - Paesi Sviluppati	8,93
Asia - Emergente	2,13

Anagrafica

Società di Gestione	RAM Active Investments SA	Patrimonio Classe (Mln)	0,43 CHF	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+41 58 726 8700	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.ram-ai.com	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	-
Data di Partenza	18/10/2017	UCITS	Si	Spese correnti	3,15%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	15/12/2016	ISIN	LU1520762409		
NAV (28/01/2020)	CHF 86,61				
Patrimonio Netto (Mln)	18,96 USD				

(30/09/2024)