

RAM (Lux) Systematic Funds - Global Market Neutral Equity X USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001004

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

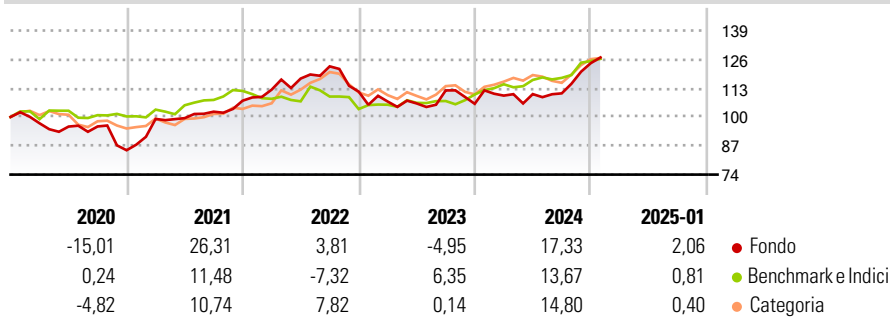
The investment objective of the sub-fund is to seek capital growth in the medium to long term via a diversified and sustainable long/short equity portfolio incorporating environmental, social and governance (ESG) criteria, while partially or fully limiting exposure to the directional risk of the equity 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	-1,93	3Y Sharpe Ratio	0,31
3Y Beta	-0,21	3Y Std Dev	10,83
3Y R-Squared	7,32	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,06	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	11,43	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

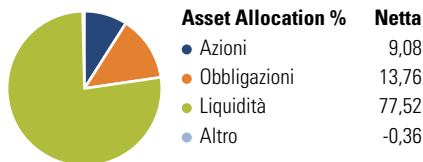
Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,60	1,97	3,40	2025	-	-	-	-
6-Mesi	14,65	8,36	11,52	2024	3,50	0,62	0,30	12,32
1-Anno	12,48	12,32	12,99	2023	-4,03	-0,80	5,55	-5,40
3-Anni Ann.ti	4,94	5,58	10,91	2022	4,65	4,44	4,68	-9,26
5-Anni Ann.ti	3,65	3,58	8,37	2021	16,61	0,35	2,95	4,85
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 20/02/2025

Portafoglio 30/09/2024



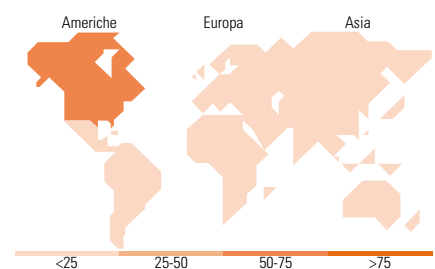
Fixed Income

Style Box™

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva -
Maturity effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



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 %

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

Coupon 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 %

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)	0,07 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+41 58 726 8700	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.ram-ai.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	4,09%
Data di Partenza	23/07/2019	UCITS	Si	Spese correnti	3,64%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	15/12/2016	ISIN	LU1960245733		
NAV (20/02/2025)	USD 114,27				
Patrimonio Netto (Mln)	18,96 USD				

(30/09/2024)