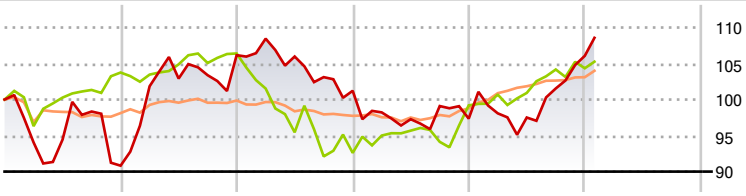
RAM (Lux) Systematic Funds - Global Market Neutral Equity XNH EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Azionario Market Neutral	Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report	Not Benchmarked	★★

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.

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-01	
-9,18	16,89	-4,66	-3,82	8,95	2,36	Fondo
3,75	2,55	-12,96	7,12	5,19	0,87	Benchmark e Indici
-0,90	1,98	-1,70	1,70	4,79	0,86	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,79	3Y Sharpe Ratio	-0,21
3Y Beta	-0,25	3Y Std Dev	6,34
3Y R-Squared	6,36	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,06	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	9,94	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,89	1,41	2,46
6-Mesi	8,13	2,27	3,97
1-Anno	7,91	6,68	7,45
3-Anni Ann.ti	0,37	1,00	5,89
5-Anni Ann.ti	1,46	0,64	5,70
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 20/02/2025

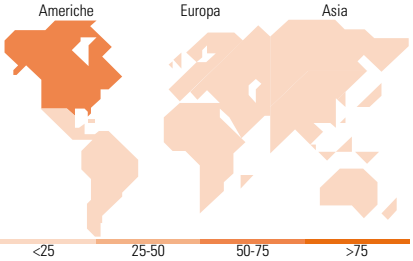
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	0,75	-0,59	4,14	4,46
2023	-2,96	-0,97	1,88	-1,76
2022	2,16	-2,29	-2,70	-1,83
2021	12,15	1,05	0,45	2,69

Portafoglio 30/09/2024

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

Fixed Income Style Box™

Fixed Income	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity 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 %	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
Telefono	+41 58 726 8700
Web	www.ram-ai.com
Data di Partenza	23/07/2019
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	15/12/2016
NAV (20/02/2025)	EUR 103,93
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2024)	18,96 USD

Patrimonio Classe (Mln) (20/02/2025)	0,45 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1960246038

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	4,23%
Spese correnti	3,72%
Commissione di incentivo	-

© 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 prodotto; (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.