# **Doubleline Shiller Enhanced CAPE® Class I USD Inc**

Categoria Morningstar™

Azionari USA Large Cap Blend

## **Benchmark Morningstar**

Morningstar US Large-Mid Cap NR USD

#### **Benchmark Dichiarato**

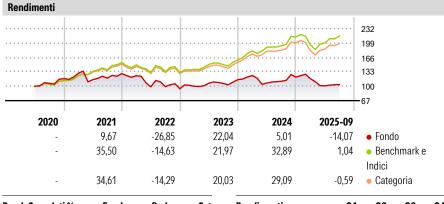
S&P 500 TR EUR

### Morningstar Rating™

\*

### **Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

The Sub-Fund's investment objective is to seek total return which exceeds the total return of the S&P 500 index. The objective of the Sub-Fund is to outperform the S&P 500 index by combining an exposure to the Shiller Barclays CAPE® US Sector II ER USD Index (the "Index") and to debt securities as described below. Further information on the Index is contained under "General Description of the Index".



Misure di Rischio				
3Y Alpha	-11,19	3Y Sharpe Ratio	0,01	
3Y Beta	0,86	3Y Std Dev	17,54	
3Y R-Squared	42,58	3Y Risk	Alto	
3Y Info Ratio	-1,21	5Y Risk	Alto	
3Y Tracking Error	13,65	10Y Risk	-	
Basati su Morningstar US Large-Mid Cap NR USD (dove applicabile)				

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,56	5,34	5,50	Trimestrali %				
6-Mesi	-1,56	23,43	20,93	2025	-2,85	-14,08	2,95	-
1-Anno	-10,54	7,03	5,18	2024	8,24	-13,81	3,81	8,43
3-Anni Ann.ti	2,23	17,00	14,77	2023	6,03	6,90	-0,58	8,30
5-Anni Ann.ti	-1,23	14,52	13,45	2022	-3,68	-20,67	0,54	-4,78
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 16/10/2	2025	-	-	2021	10,45	-11,33	3,03	8,69

### Portafoglio 30/09/2025







Titoli principali		
Nome	Settore	%
Trs Usd Bxiics2e Index /Long/	-	75,52
Trs Usd Bxiics2e /Long/	_	25,35
United States Treasury Bills	_	10,21
United States Treasury Notes	_	5,28
United States Treasury Bills	_	4,76
Merrill Lynch Mortgage	-	1,41
Bain Capital Credit CLO	_	1,37
Atlas Senior Loan Fund XI Ltd	_	1,37
WELLINGTON MANAGEMENT CLO 4	_	1,37
Bnc Mortgage Loan Trust 2007 1	_	1,29
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		127,93
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	311

Distribuzione Settoriale %	Fondo
<b>%</b> Ciclico	0,00
A Materie Prime	-
Beni di Consumo Ciclici	-
Finanza	-
	=
₩ Sensibile	0,00
Telecomunicazioni	-
<b>Tenergia</b>	-
Beni Industriali	-
Tecnologia	=
→ Difensivo	0,00
📜 Beni Difensivi	-
→ Salute	-
Servizi di Pubblica Utilità	-

<25	25-50	50-75	>75
Ripartizione Geografica %			Fondo
America			0,00
Stati Uniti			-
Canada			-
America Latin	a e Centrale		-
Europa			0,00
Regno Unito			-
Europa Occide	entale - Euro		-
Europa Occide	entale - Non E	uro	-
Europa dell'Es	t		-
Africa			-
Medio Oriente	)		-
Asia			0,00
Giappone			-
Australasia			-
Asia - Paesi Sv	viluppati		-
Asia - Emerge	nte		-

rafica

Società di Gestione	DoubleLine Alternatives LP
Telefono	-
Web	-
Data di Partenza	05/06/2020
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	30/09/2016
NAV (16/10/2025)	USD 8,91
Patrimonio Netto (MIn)	146,41 USD
(20/00/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	0,65 USD
(16/10/2025)	
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU2168289333

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,55%
Spese correnti	0,55%
Commissione di incentivo	-