

# Doubleline Shiller Enhanced CAPE® Class I USD Inc

**Categoria Morningstar™**  
Azione USA Large Cap Blend

**Benchmark Morningstar**  
Morningstar US Large-Mid Cap NR USD  
Usato nel Report

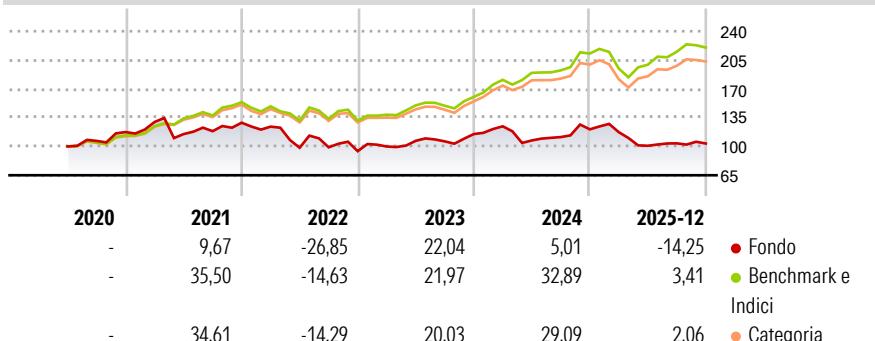
**Benchmark Dichiarato**  
S&P 500 TR EUR

**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".

## Rendimenti



## Misure di Rischio

3Y Alpha	-10,04	3Y Sharpe Ratio	0,09
3Y Beta	0,78	3Y Std Dev	16,24
3Y R-Squared	32,38	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	-1,14	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	14,10	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Large-Mid Cap NR USD (dove applicabile)

## Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,16	5,44	4,84
6-Mesi	4,77	11,07	10,55
1-Anno	-12,12	4,49	2,75
3-Anni Ann.ti	2,27	18,76	16,65
5-Anni Ann.ti	-2,09	14,38	13,33
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 16/01/2026

## Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-2,85	-14,08	2,95	-0,21
2024	8,24	-13,81	3,81	8,43
2023	6,03	6,90	-0,58	8,30
2022	-3,68	-20,67	0,54	-4,78

## Portafoglio 31/12/2025

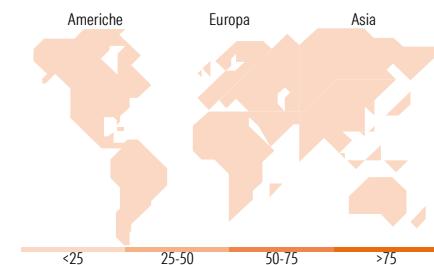


Asset Allocation %	Netta
• Azioni	0,00
• Obbligazioni	84,26
• Liquidità	16,19
• Altro	-0,45



**Mkt Cap %**  
Capitalizzazione media di mercato  
Ave Mkt Cap USD

**Fondo**  
Fondo



## Titoli principali

Nome	Settore	%
Trs Usd Bxics2e Index /Long/	-	106,90
United States Treasury Bills	-	12,25
United States Treasury Notes...	-	9,87
Merrill Lynch Mortgage...	-	1,71
Bain Capital Credit CLO...	-	1,65
Atlas Senior Loan Fund XI Ltd	-	1,65
WELLINGTON MGMT 4 LTD/LLC	-	1,64
Bnc Mortgage Loan Trust 2007 1	-	1,55
Washington Mutual...	-	1,39
Wamu Abc Tr 07-He4	-	1,37
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		139,99
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	293	

## Distribuzione Settoriale %

	Fondo
• Ciclico	0,00
▪ Materie Prime	-
▪ Beni di Consumo Ciclici	-
▪ Finanza	-
▪ Immobiliare	-
• Sensibile	0,00
▪ Telecomunicazioni	-
▪ Energia	-
▪ Beni Industriali	-
▪ Tecnologia	-
• Difensivo	0,00
▪ Beni Difensivi	-
▪ Salute	-
▪ Servizi di Pubblica Utilità	-

## Ripartizione Geografica %

	Fondo
• America	0,00
▪ Stati Uniti	-
▪ Canada	-
▪ America Latina e Centrale	-
• Europa	0,00
▪ Regno Unito	-
▪ Europa Occidentale - Euro	-
▪ Europa Occidentale - Non Euro	-
▪ Europa dell'Est	-
▪ Africa	-
▪ Medio Oriente	-
• Asia	0,00
▪ Giappone	-
▪ Australasia	-
▪ Asia - Paesi Sviluppati	-
▪ Asia - Emergenti	-

## Anagrafica

Società di Gestione	DoubleLine Alternatives LP	Patrimonio Classe (Mln)	0,67 USD	Investimento Min. Ingresso
Telefono	-	(16/01/2026)		Investimento Min. Successivo
Web	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Data di Partenza	05/06/2020	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo
Data Inizio Gestione	30/09/2016	Inc/Acc	Inc	
NAV (16/01/2026)	USD 9,05	ISIN	LU2168289333	
Patrimonio Netto (Mln)	121,56 USD			
(31/12/2025)				