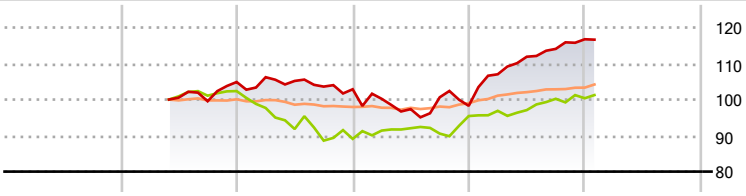
RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity XB EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Azionario Market Neutral	Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report	No benchmark	★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Ricerca di un apprezzamento del capitale a medio-lungo termine. Mediante l'utilizzo di strategie di copertura, il comparto neutralizza totalmente o parzialmente l'esposizione ai rischi direzionali dei mercati azionari europei. Il comparto investe una quota minima del 75% in azioni di società aventi sede in uno Stato membro dell'Unione europea e in Norvegia. L'esposizione "long" ai mercati azionari può oscillare tra il 75% e il 130%. L'esposizione "short" può invece variare tra lo 0% e il 130%. Il gestore può utilizzare strumenti derivati a titolo di copertura o per ottimizzare l'esposizione del portafoglio. Il comparto potrà investire fino al 10% del suo patrimonio netto in quote di OICVM o di altri OIC.

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-01	
-	-	-1,91	-4,46	18,81	-0,10	Fondo
-	-	-12,96	7,12	5,19	0,87	Benchmark e Indici
-	-	-1,70	1,70	4,79	0,85	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,34	3Y Sharpe Ratio	0,31
3Y Beta	-0,44	3Y Std Dev	7,05
3Y R-Squared	15,50	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,37	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	11,08	10Y Risk	-

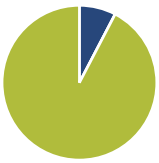
Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,21	2,13	2,25
6-Mesi	5,35	2,92	3,93
1-Anno	13,05	6,10	7,15
3-Anni Ann.ti	4,32	0,70	5,49
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	8,91	4,56	1,94	2,35
2023	-2,59	-2,85	3,38	-2,34
2022	1,28	-0,98	-1,49	-0,72
2021	-	-	-0,97	5,35

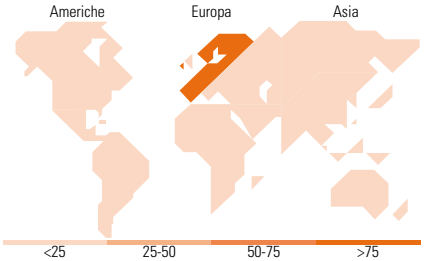
Portafoglio 30/09/2024



Asset Allocation %	Netta
Azioni	7,66
Obbligazioni	0,00
Liquidità	92,34
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

Fondo	
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Henkel AG & Co KGaA...		1,95
Rockwool AS Class B		1,88
OMV AG		1,72
Unipol Gruppo SpA...		1,65
Merck KGaA		1,62
Evonik Industries AG		1,59
Essity AB Class B		1,58
NKT AS		1,57
Deutsche Boerse AG		1,54
Wolters Kluwer NV		1,50
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		16,61
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.096
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	100,00
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	0,00
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	**0,58**
Stati Uniti	0,58
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**99,08**
Regno Unito	19,97
Europa Occidentale - Euro	50,62
Europa Occidentale - Non Euro	27,89
Europa dell'Est	0,34
Africa	0,22
Medio Oriente	0,04
Asia	**0,34**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,34
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	RAM Active Investments SA
Telefono	+41 58 726 8700
Web	www.ram-ai.com
Data di Partenza	03/05/2021
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	15/12/2011
NAV (03/02/2025)	EUR 119,80
Patrimonio Classe (Mln) (03/02/2025)	1,31 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2191842710
Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	3,28%
Spese correnti	3,34%
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.

RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity XB EUR

Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2024)	147,11 EUR

© 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.