

Ellipsis Optimal Solutions Liquid Alternative SEUR

Categoria Morningstar™

Alt - Long/Short Azionario Europa

Benchmark Morningstar

Morningstar Developed Europe Target

Market Exposure NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ESTR + 1%

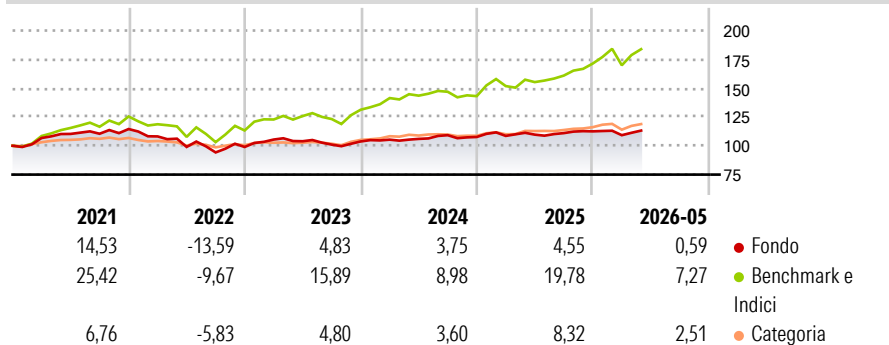
Morningstar Rating™

★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

-

Rendimenti



Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | -4,44 | 3Y Sharpe Ratio | 0,01 |
| 3Y Beta | 0,40 | 3Y Std Dev | 5,05 |
| 3Y R-Squared | 69,94 | 3Y Risk | -Med |
| 3Y Info Ratio | -1,67 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 6,92 | 10Y Risk | - |

Basati su Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %

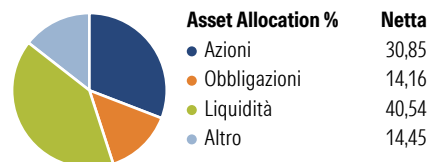
| | Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 3,56 | 11,40 | 6,70 |
| 6-Mesi | 0,77 | 9,67 | 8,08 |
| 1-Anno | 3,37 | 21,64 | 15,17 |
| 3-Anni Ann.ti | 3,12 | 14,81 | 10,86 |
| 5-Anni Ann.ti | 0,42 | 10,10 | 6,31 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 23/06/2026

Rendimenti

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2026 | -2,96 | - | - | - |
| 2025 | 0,89 | 1,00 | 1,19 | 1,40 |
| 2024 | 1,51 | 0,64 | 3,04 | -1,43 |
| 2023 | 6,50 | -1,40 | -2,81 | 2,71 |
| 2022 | -5,59 | -8,45 | -4,81 | 5,03 |

Portafoglio 31/05/2026



Style Box Azionaria

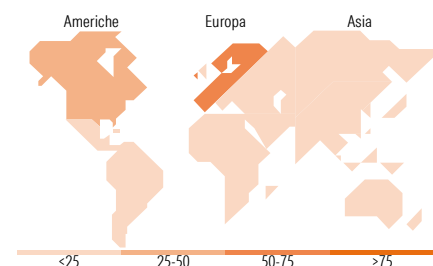


Mkt Cap %

| Fondo | Fondo |
|--------|-------|
| Giant | 63,71 |
| Large | 27,92 |
| Medium | 8,14 |
| Small | 0,24 |
| Micro | 0,00 |

Capitalizzazione media di mercato

| Fondo | Fondo |
|-----------------|------------|
| Ave Mkt Cap EUR | 236.693,47 |



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Option on EURO STOXX 50 PR EUR | - | 30,55 |
| TRS SXXRPAB AUG 26 @ 166.84... | - | 14,47 |
| Option on S&P 500 PR | - | 6,55 |
| Ellipsis Optimal Sltns- Alt... | - | 6,18 |
| Option on STOXX Europe 600... | - | 5,71 |
| AstraZeneca PLC 1.25% | - | 4,11 |
| Nestle Finance International... | - | 3,70 |
| Call Sx7p 350 E 12/18/2026... | - | 3,37 |
| Option on STOXX Europe 600... | - | 3,35 |
| ASML Holding NV | 📄 | 3,24 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 81,23 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 23 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 5 |

Distribuzione Settoriale %

| Fondo | Fondo |
|-----------------------------|--------------|
| Ciclico | 32,20 |
| Materie Prime | 2,72 |
| Beni di Consumo Ciclici | 10,70 |
| Finanza | 18,30 |
| Immobiliare | 0,48 |
| Sensibile | 48,17 |
| Telecomunicazioni | 7,59 |
| Energia | 3,28 |
| Beni Industriali | 11,25 |
| Tecnologia | 26,05 |
| Difensivo | 19,63 |
| Beni Difensivi | 8,25 |
| Salute | 8,96 |
| Servizi di Pubblica Utilità | 2,42 |

Ripartizione Geografica %

| Fondo | Fondo |
|-------------------------------|--------------|
| America | 44,21 |
| Stati Uniti | 43,96 |
| Canada | 0,24 |
| America Latina e Centrale | 0,01 |
| Europa | 55,69 |
| Regno Unito | 3,03 |
| Europa Occidentale - Euro | 43,54 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 8,98 |
| Europa dell'Est | 0,13 |
| Africa | 0,00 |
| Medio Oriente | 0,00 |
| Asia | 0,10 |
| Giappone | 0,00 |
| Australasia | 0,00 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 0,08 |
| Asia - Emergente | 0,02 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|----------------|
| Società di Gestione | Ellipsis Asset Management | Patrimonio Classe (Mln) | 14,68 EUR | Investimento Min. Ingresso | 10.000.000 EUR |
| Telefono | - | (23/06/2026) | - | Investimento Min. Successivo | 1/1.000 Quota |
| Web | www.ellipsis-am.com | Domicilio | FRANCIA | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 28/12/2016 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,52% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 28/06/2021 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (23/06/2026) | EUR 13.839,56 | ISIN | FR0013198017 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 37,82 EUR | | | | |

(31/05/2026)

See disclosures for more details

© 2026 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 prodotte; (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.