## RAM (Lux) Systematic Funds - Global Market Neutral Equity X USD

Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001004

**Benchmark Morningstar** 

Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report **Benchmark Dichiarato** 

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

\*\*

## **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 portfolio with long/short exposure to equity or equity indices, directly or indirectly through the use of derivative instruments or indices, while seeking to limit 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.

Misure di Rischio	ı		
3Y Alpha	1,41	3Y Sharpe Ratio	-0,29
3Y Beta	-0,36	3Y Std Dev	10,34
3Y R-Squared	12,56	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,46	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	10,32	10Y Risk	-
Basati su Morningstar US applicabile)	Conserva	tive Target Allocation NR	USD (dove

## Rendimenti 126 113 100 87 2020 2021 2022 2023 2024 2025-10 -15,01 26,31 3,81 -4,95 17,33 -3,88 Fondo 0,24 11,48 -7,32 6,35 13,67 -2,14 Benchmark e Indici -4,82 10,74 7,82 0,14 14,80 -5,54 Categoria

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,62	2,91	1,84	Trimestrali %				
6-Mesi	-1,44	5,88	0,94	2025	0,77	-5,05	-0,73	-
1-Anno	4,26	3,02	1,69	2024	3,50	0,62	0,30	12,32
3-Anni Ann.ti	-0,37	3,90	2,71	2023	-4,03	-0,80	5,55	-5,40
5-Anni Ann.ti	4,40	4,00	7,26	2022	4,65	4,44	4,68	-9,26
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	16,61	0,35	2,95	4,85
Rendimenti aggiornati al 30/10/2	2025							

Fondo

## Portafoglio 30/06/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva 
Maturity effettiva 
Qualità Credito Media



<b>Titoli principali</b> Nome Settor	e %
United States Treasury Notes	- 10,02
CFD on Sherwin-Williams Co	- 1,29
CFD on Equitable Holdings Inc -	- 0,83
EMCOR Group Inc	0,79
CFD on Pool Corp -	- 0,78
LG Uplus Corp	0,74
Israel Discount Bank Ltd	0,74
CFD on FirstService Corp	- 0,73
Fincantieri SpA	0,73
Verint Systems Inc	0,71
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	17,36
Numero Complessivo di Titoli Azionari	748
NumeroComplessivodiTitoliObbligazion ari	1

₩ Governativo	10,39
© Societario	0,00
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	77,07
Derivati	12,54
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
Da 10 a 12 ccubic	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	52,54
Stati Uniti	45,49
Canada	6,95
America Latina e Centrale	0,10
Europa	20,68
Regno Unito	6,28
Europa Occidentale - Euro	9,33
Europa Occidentale - Non Euro	2,63
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,45
Medio Oriente	1,99
Asia	26,78
Giappone	12,57
Australasia	2,74
Asia - Paesi Sviluppati	8,50
Asia - Emergente	2,97

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 (30/10/2025)	USD 120,64
Patrimonio Netto (MIn)	19.97 USD

Patrimonio Classe (MIn)	0,13 USD
(30/10/2025)	
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1960245733

Investimento Min. Ingresso	=
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	-
Spese correnti	3,64%
Commissione di incentivo	-