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

Categoria Morningstar™
Alt - Azionario Market Neutral

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

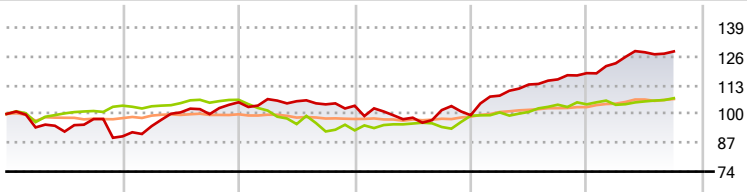
Benchmark Dichiarato
No benchmark

Morningstar Rating™
★★★★

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	2025-09
Fondo	-10,10	17,09	-1,50	-4,08	19,06	8,28
Benchmark e Indici	3,75	2,55	-12,96	7,12	5,19	2,65
Categoria	-0,90	1,98	-1,70	1,70	4,79	3,72

Misure di Rischio

3Y Alpha	6,32	3Y Sharpe Ratio	0,61
3Y Beta	-0,93	3Y Std Dev	7,03
3Y R-Squared	36,99	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,19	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	10,40	10Y Risk	-

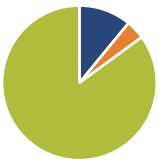
Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,41	2,26	1,79
6-Mesi	2,32	5,02	1,28
1-Anno	7,42	4,27	5,16
3-Anni Ann.ti	6,62	5,85	5,74
5-Anni Ann.ti	5,12	1,30	4,80
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 22/10/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	3,76	4,05	0,30	-
2024	8,85	4,64	2,03	2,45
2023	-2,49	-2,76	3,48	-2,25
2022	1,36	-0,89	-1,34	-0,62
2021	5,12	6,57	-0,79	5,35

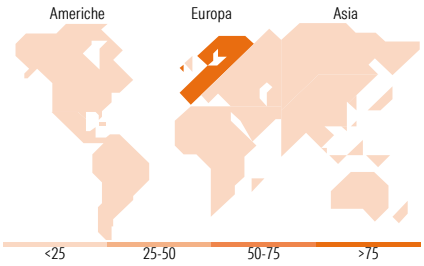
Portafoglio 30/06/2025



Asset Allocation %	Netta
Azioni	10,95
Obbligazioni	3,98
Liquidità	85,07
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

Fondo	
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Germany (Federal Republic...	—	3,98
Poste Italiane SpA		1,64
IONOS Group SE Registered...		1,39
Flatex AG		1,36
Italgas SpA		1,36
adidas AG		1,29
International Consolidated...		1,23
Merck KGaA		1,12
Mapfre SA		1,11
Nordex SE Akt. nach...		1,06
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		15,54
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.260
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		1

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	4,47
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	96,24
Derivati	-0,71

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	100,00
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	**0,97**
Stati Uniti	0,25
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,72
Europa	**98,78**
Regno Unito	21,04
Europa Occidentale - Euro	54,19
Europa Occidentale - Non Euro	23,48
Europa dell'Est	0,06
Africa	0,01
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,25**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,25
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	RAM Active Investments SA	Patrimonio Classe (Mln) (21/10/2025)	4,06 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+41 58 726 8700			Investimento Min. Successivo	-
Web	www.ram-ai.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	26/07/2019	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	2,87%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	15/12/2011	Inc/Acc	Acc		
NAV (22/10/2025)	EUR 126,21	ISIN	LU1960244926		

© 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.

MORNINGSTAR

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

Patrimonio Netto (MIn)	178,44 EUR
(30/06/2025)	

© 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.