# **Doubleline Shiller Enhanced CAPE® Class A USD Inc**

Categoria Morningstar™

Azionari USA Large Cap Blend

## Benchmark Morningstar

Morningstar US Large-Mid Cap NR USD

#### **Benchmark Dichiarato**

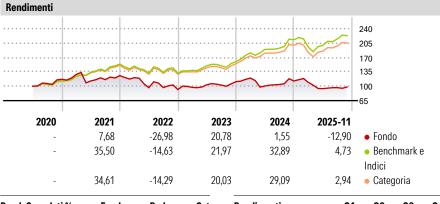
S&P 500 TR EUR

#### Morningstar Rating™

 $\star$ 

#### **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".



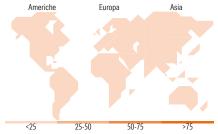
Misure di Rischio				
3Y Alpha	-12,73	3Y Sharpe Ratio	-0,17	
3Y Beta	0,81	3Y Std Dev	17,87	
3Y R-Squared	34,45	3Y Risk	Alto	
3Y Info Ratio	-1,22	5Y Risk	Alto	
3Y Tracking Error	14,68	10Y Risk	-	
Basati su Morningstar US L	arge-Mid Ca	p NR USD (dove applicabile)		

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4	
3-Mesi	-0,56	6,48	5,61	Trimestrali %					
6-Mesi	1,67	12,07	11,91	2025	-3,11	-13,88	2,68	-	
1-Anno	-18,20	2,71	0,84	2024	7,96	-15,99	3,53	8,14	
3-Anni Ann.ti	-0,33	17,51	14,83	2023	5,75	6,63	-0,84	8,02	
5-Anni Ann.ti	-3,73	14,54	13,71	2022	-3,97	-20,15	0,27	-5,03	
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 08/12/2	- 2025	-	-	2021	10,18	-12,32	2,79	8,43	

### Portafoglio 30/11/2025







<b>Titoli principali</b> Nome	Settore	%
Trs Usd Bxiics2e Index /Long/	-	102,05
US T BILL ZCP 03/17/26	-	11,11
United States Treasury Notes	_	8,99
United States Treasury Notes	_	5,83
Merrill Lynch Mortgage	_	1,56
Bain Capital Credit CLO	_	1,50
WELLINGTON MGMT 4 LTD/LLC	_	1,50
Atlas Senior Loan Fund XI Ltd	-	1,50
Bnc Mortgage Loan Trust 2007 1	-	1,42
Washington Mutual	-	1,27
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		136,74
Numero Complessivo di Titoli Azionari	i	0
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	297

Distribuzione Settoriale %	Fondo
<b>∿</b> Ciclico	0,00
🚣 Materie Prime	-
🔼 Beni di Consumo Ciclici	=
🚅 Finanza	=
	-
₩ Sensibile	0,00
Telecomunicazioni	-
<b>Tenergia</b>	-
🔯 Beni Industriali	-
Tecnologia	-
→ Difensivo	0,00
🔚 Beni Difensivi	-
Calute Salute	-
Servizi di Pubblica Utilità	

<25	25-50	50-75	>75
Ripartizione Geografica %			Fondo
America			0,00
Stati Uniti			-
Canada			-
America Latir	a e Centrale		-
Europa			0,00
Regno Unito			-
Europa Occid	entale - Euro		-
Europa Occid	entale - Non E	uro	-
Europa dell'Es	st		-
Africa			-
Medio Oriente	)		-
Asia			0,00
Giappone			-
Australasia			-
Asia - Paesi S	viluppati		-
Asia - Emerge	ente		-

Società di Gestione	DoubleLine Alternatives LP
Telefono	-
Web	-
Data di Partenza	05/06/2020
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	30/09/2016
NAV (08/12/2025)	USD 8,68
Patrimonio Netto (MIn)	133,49 USD
(30/11/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	1,09 USD
(08/12/2025)	
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU2168289689

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,60%
Spese correnti	1,60%
Commissione di incentivo	=