

Ellipsis Optimal Solutions- Alternative Hedging REUR

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

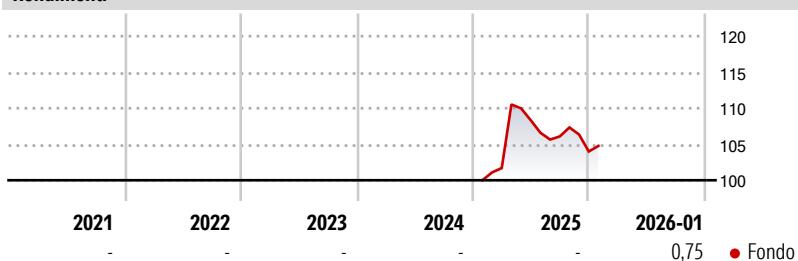
€STR capitalisé + 2%

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

Fondo

3-Mesi	-1,59
6-Mesi	-1,07
1-Anno	-
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Rendimenti Trimestrali %

Q1 Q2 Q3 Q4

2026	-	-	-
2025	-	6,53	-2,08
2024	-	-	-1,97
2023	-	-	-
2022	-	-	-

Portafoglio 28/02/2025



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	83,51
● Obbligazioni	0,00
● Liquidità	16,49
● Altro	0,00

Fixed Income Style

Box™

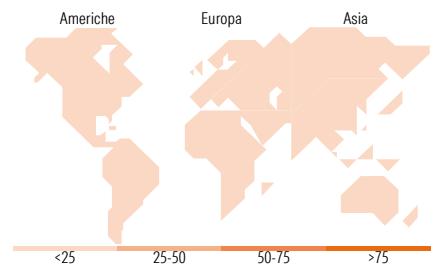


Duration Effettiva

Maturity effettiva

Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Call Sx5e 1000 E 03/21/2025...	-	55,26
Option on S&P 500 PR	-	13,41
Put Sx5e 6000 E 03/21/2025...	-	6,75
Put Sxpx 525 E 12/19/2025...	-	6,68
Option on S&P 500 PR	-	6,13
Put Sx7e 170 E 12/19/2025...	-	5,28
Put Sx7e 140 E 12/19/2025...	-	0,93
Put Sxpx 430 E 12/19/2025...	-	0,78
Put Alv 305 A 12/19/2025...	-	0,22
Call Sxpx 580 E 04/17/2025...	-	0,16
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	95,60	
Numero Complessivo di Titoli Azionari	3	
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	99,27
Derivati	0,73

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 %

America

Fondo

Stati Uniti

Canada

America Latina e Centrale

Europa

0,00

Regno Unito

Europa Occidentale - Euro

Europa Occidentale - Non Euro

Europa dell'Est

Africa

Medio Oriente

Asia

0,00

Giappone

Australasia

Asia - Paesi Sviluppati

Asia - Emergenti

Anagrafica

Società di Gestione	Ellipsis Asset Management
Telefono	-
Web	www.ellipsis-am.com
Data di Partenza	31/01/2025
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	-
NAV (30/01/2026)	EUR 104,77
Patrimonio Netto (Mln)	24,96 EUR
(28/02/2025)	

Patrimonio Classe (Mln)

35,01 EUR

(30/01/2026)

FRANCIA

Domicilio

EUR

Valuta del Fondo

Si

UCITS

Acc

Inc/Acc

ISIN

FR001400UZ66

Investimento Min. Ingresso

Investimento Min. Successivo

T.E.R.

Spese correnti

Commissione di incentivo

15,00%