

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

Morningstar Categorie Index

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

No benchmark

Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Alt - Market Neutral - Equity

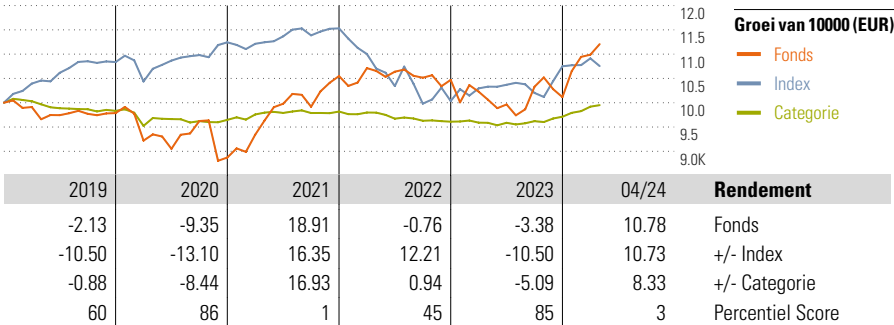
Beleggingsdoelstelling

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, 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.

Risicomaatstaven

Alpha	3.25	Sharpe Ratio	0.53
Beta	-0.30	Std Deviatie	7.62
R-kwadraat	6.08	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.60	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	10.97	10-jr Risico	Hoog

Berekeningen met Morningstar EU Cau Gbl Tgt Alloc NR EUR (waar van toepassing)



Rendementen (15 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	3.09	1.36	0.08
6 Maanden	8.63	3.11	1.88
1 jaar	11.32	5.43	0.27
3 jr gean.	4.25	5.12	-0.18
5 jr gean.	2.65	1.76	-0.99

Kwartaalrendementen

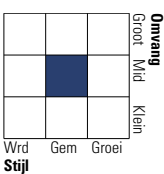
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	8.63	-	-	-
2023	-2.31	-2.57	3.66	-2.07
2022	1.54	-0.69	-1.16	-0.43
2021	5.32	6.80	-0.63	6.38
2020	-5.79	-1.84	6.33	-7.81

Portefeuille 31 dec 2023

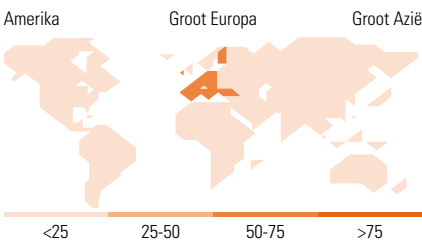
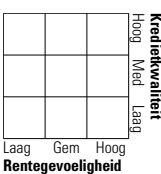
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	138.88	129.99	8.89
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	101.94	10.82	91.11
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Novo Nordisk A/S Class B	+	1.68
BW LPG Ltd	+	1.50
A2A SpA	+	1.45
Carlsberg A/S Class B	+	1.40
CFD on Legrand SA	-	1.35
Demant A/S	+	1.32
Henkel AG & Co KGaA...	+	1.31
Redcare Pharmacy NV	+	1.25
Henkel AG & Co KGaA	+	1.18
Scout24 SE	+	1.18
Totaal Aantal Aandelen		1179
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		13.62

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	32.76
Basismaterialen	6.10
Cyclische consumentenproducten	13.72
Financiële dienstverlening	11.26
Vastgoed	1.67
Licht Cyclisch	40.46
Communicatiediensten	5.54
Energie	4.90
Industrie	22.77
Technologie	7.26
Defensief	26.78
Defensieve consumptiegoederen	11.20
Gezondheidszorg	12.31
Nutsbedrijven	3.26

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	0.47
Verenigde Staten	0.47
Canada	0.00
Latijns Amerika	0.00
Groot Europa	98.44
Verenigd Koninkrijk	24.12
West Europa – Euro	50.24
West Europa – Niet Euro	23.88
Emerging Europa	0.19
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	1.09
Japan	0.00
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	1.08
Azië - Emerging	0.01

Fondsinformatie

Fondsgroep	RAM Active Investments...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1,000,000
Telefoon	L-1855	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	-	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	15 dec 2011	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Emmanuel Hauptmann	ISIN	LU0705071701		
Aanvangsdatum	15 dec 2011				
Koers (15 mei 2024)	EUR 163.09				
Fondsvermogen (mln)	EUR 18.27				