

RAM (Lux) Systematic Funds - European Market Neutral Equity DH USD

Morningstar Categorie Index

Morningstar US Conservative Target
Allocation NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

No benchmark

Morningstar Rating™

★★★

Morningstar Categorie™

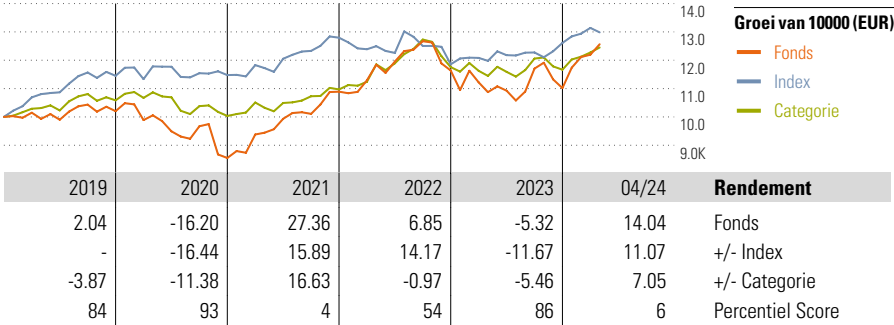
Beleggingsdoelstelling

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	1.86	Sharpe Ratio	0.75
Beta	-0.27	Std Deviatie	11.80
R-kwadraat	8.50	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.51	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	12.32	10-jr Risico	Hoog

Berekeningen met Morningstar US Con Tgt Alloc NR USD (waar van toepassing)



Rendementen (16 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	1.52	0.36	-1.01
6 Maanden	8.36	1.40	0.58
1 jaar	11.64	4.15	-0.99
3 jr gean.	8.65	4.60	-2.03
5 jr gean.	4.00	0.18	-1.96

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	10.68	-	-	-
2023	-3.57	-2.63	7.13	-5.87
2022	3.68	5.85	6.03	-8.17
2021	9.69	5.91	1.74	7.76
2020	-3.09	-4.01	1.89	-11.58

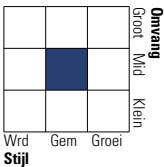
Portefeuille 31 dec 2023

Assetverdeling

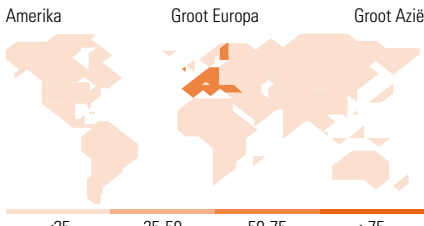
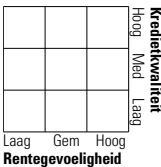
	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	138.88	129.99	8.89
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	101.94	10.82	91.11
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Novo Nordisk A/S Class B	Medicijnen	1.68
BW LPG Ltd	Industrie	1.50
A2A SpA	Industrie	1.45
Carlsberg A/S Class B	Industrie	1.40
CFD on Legrand SA	Industrie	1.35
Demant A/S	Industrie	1.32
Henkel AG & Co KGaA...	Industrie	1.31
Redcare Pharmacy NV	Industrie	1.25
Henkel AG & Co KGaA	Industrie	1.18
Scout24 SE	Industrie	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	-
Telefoon	L-1855	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	-	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	1.60%
Oprichtingsdatum	16 dec 2011	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Emmanuel Hauptmann	ISIN	LU0705071610		
Aanvangsdatum	15 dec 2011				
Koers (16 mei 2024)	USD 172.43				
Fondsvermogen (mln)	EUR 137.34				