

Lombard Odier Funds - Transition Materials Syst. Hdg (EUR) PA

Categoria Morningstar™

Materie Prime - Generiche

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Bloomberg Commodity TR Hdg CHF

Morningstar Rating™

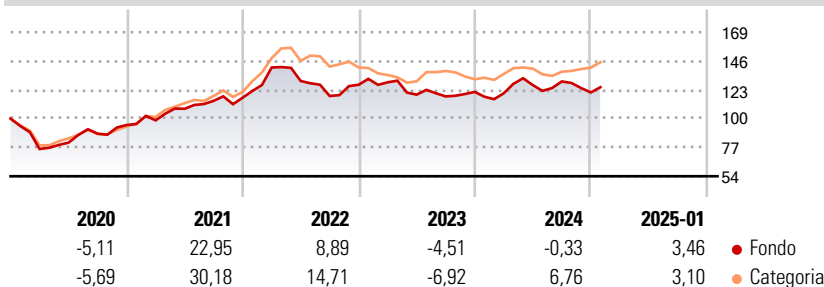
Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Il Comparto mira a replicare la performance del LOIM Commodity Index, un indice conforme alla direttiva OICVM IV con un'esposizione ampia e diversificata alle materie prime che replica la performance di ventuno future su commodity selezionati in quattro ampi settori quali metalli industriali, metalli preziosi, energia e agricoltura. Il Gestore applica una metodologia proprietaria che determina e adegua la ponderazione di ogni settore in modo che il suo contributo al rischio complessivo del portafoglio tenda a essere equivalente a quello degli altri rispettivi settori (maggiore è il rischio di fluttuazione di un settore, minore sarà la ponderazione nel portafoglio).

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,04
3Y Beta	-	3Y Std Dev	13,80
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

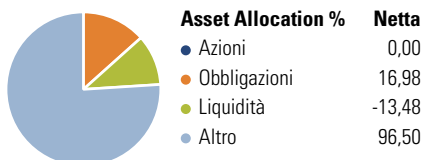
Rendimenti

Rend. Cumulati %

	Fondo	Cat
3-Mesi	-2,44	5,97
6-Mesi	3,65	9,15
1-Anno	8,58	11,57
3-Anni Ann.ti	0,23	1,65
5-Anni Ann.ti	6,15	8,79
10-Anni Ann.ti	0,14	0,59

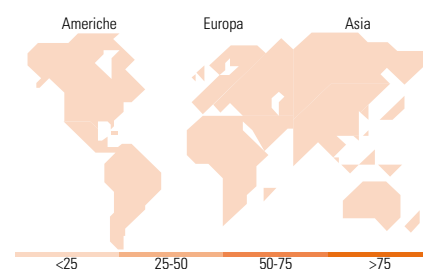
Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	-0,89	5,47	2,26	-6,75
2023	1,51	-7,63	-1,19	3,05
2022	20,69	-7,65	-9,19	7,59
2021	3,91	9,38	5,87	2,18

Portafoglio 31/07/2024

Fixed Income
Style Box™

Sensibilità ai Tassi

Fondo
 Duration Effettiva -
 Maturity effettiva -
 Qualità Credito Media

Titoli principali

Nome	Settore	%
Trsgs Cnym Us041124p-Trsgs...	-	96,50
Single Platform Investment...	-	2,52
United States Treasury Bills...	-	2,51
United States Treasury Bills...	-	2,50
United States Treasury Bills...	-	2,14
Swiss National Bank 0%	-	1,91
Swiss National Bank 0%	-	1,91
Metropolitan Life Global...	-	1,70
Canadian Imperial Bank of...	-	1,69
UBS Group AG 3.75%	-	1,68
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		115,05
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		17

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	374,45
Societario	458,73
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-730,39
Derivati	-2,79

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	14,82
Da 4 a 6 cedole	57,19
Da 6 a 8 cedole	27,99
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	0,00
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 Sviluppatti	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Lombard Odier Funds (Europe) SA	Patrimonio Classe (Mln)	2,44 EUR	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	00352 27 78 5000	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.loim.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,85%
Data di Partenza	06/07/2011	UCITS	Si	Spese correnti	1,89%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/07/2011	ISIN	LU0640921622		
NAV (03/02/2025)	EUR 6,36				

Lombard Odier Funds - Transition Materials Syst. Hdg (EUR) PA

Patrimonio Netto (Mln) 124,94 USD

(31/07/2024)