

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

Categoria Morningstar™

Materie Prime - Generiche

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Bloomberg Commodity TR Hdg CHF

Morningstar Rating™

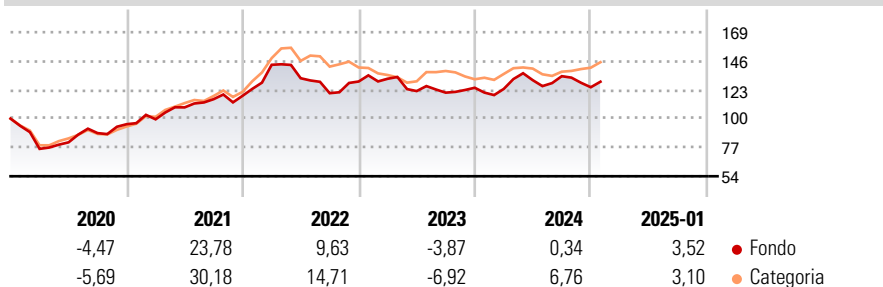
Senza rating

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 | 0,01 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 13,80 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

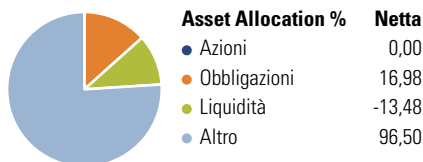
Rendimenti

Rend. Cumulati %

| | Fondo | Cat |
|----------------|-------|-------|
| 3-Mesi | -2,26 | 5,97 |
| 6-Mesi | 4,00 | 9,15 |
| 1-Anno | 9,32 | 11,57 |
| 3-Anni Ann.ti | 0,91 | 1,65 |
| 5-Anni Ann.ti | 6,87 | 8,79 |
| 10-Anni Ann.ti | 0,82 | 0,59 |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti

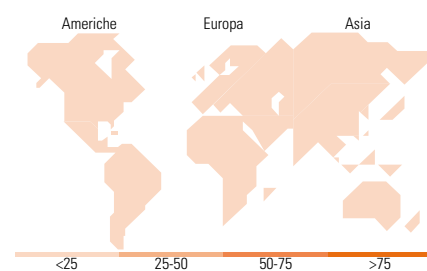
| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | -0,73 | 5,64 | 2,43 | -6,59 |
| 2023 | 1,69 | -7,47 | -1,02 | 3,22 |
| 2022 | 20,90 | -7,49 | -9,04 | 7,77 |
| 2021 | 4,09 | 9,57 | 6,05 | 2,35 |

Portafoglio 31/07/2024

Fixed Income
Style Box™

| | | Qualità Credito | | |
|----------------------|-------|-----------------|-----|-------|
| | | Alto | Med | Basso |
| Sensibilità ai Tassi | Bassa | | | |
| | Med | | | |
| Alta | | | | |

Fondo

- Duration Effettiva -
- Maturity effettiva -
- Qualità Credito Media


Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|--------|
| Trsgs Ctym 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 Sviluppatori | - |
| Asia - Emergente | - |

Anagrafica

| | | | | | |
|----------------------|---------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione | Lombard Odier Funds (Europe) SA | Patrimonio Classe (Mln) | 2,62 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. | 1,18% |
| Data di Partenza | 06/07/2011 | UCITS | Si | Spese correnti | 1,21% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 06/07/2011 | ISIN | LU0866414377 | | |
| NAV (03/02/2025) | EUR 6,83 | | | | |

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

Patrimonio Netto (Mln) 124,94 USD

(31/07/2024)