

Lumyna - Millburn Diversified UCITS Fund USD Z (acc)

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

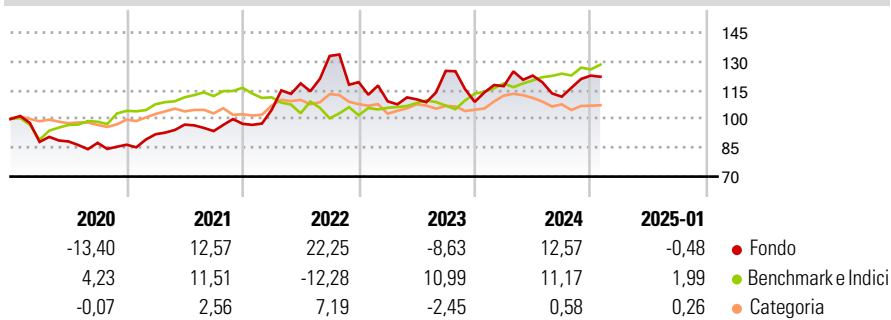
The investment objective of the Sub-Fund is to achieve capital appreciation through a fully systematic and quantitative trading approach that seeks to profit from opportunities in a wide array of liquid markets. The Sub-Fund will be managed by Millburn Ridgefield Corporation (the "Investment Manager"). The Sub-Fund is Actively Managed and is not managed in reference to a benchmark. There can be no assurance that the Sub-Fund will achieve its investment objective. The Sub-Fund will seek to achieve the investment objective primarily through investing in spot, forwards, exchange-traded futures, swaps, options and transferable securities linked to foreign currency, interest rate instruments, bonds, equity indices, metals, energy and...

Misure di Rischio

3Y Alpha	9,93	3Y Sharpe Ratio	0,39
3Y Beta	-1,38	3Y Std Dev	17,71
3Y R-Squared	42,53	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	0,15	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	24,19	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,84	4,51	3,55
6-Mesi	5,54	7,22	3,24
1-Anno	7,24	11,81	5,12
3-Anni Ann.ti	8,99	4,72	2,65
5-Anni Ann.ti	3,82	4,80	2,02
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	7,52	4,71	-8,97	9,84
2023	-8,39	0,94	13,47	-12,92
2022	7,41	13,20	12,07	-10,28
2021	6,29	5,44	-3,45	4,03

Portafoglio -

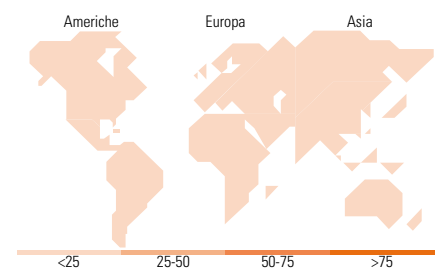
Asset Allocation % Netta

Fixed Income

Style Box™



Fondo
Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media



Titoli principali

Nome	Settore	%
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		0,00
Numero Complessivo di Titoli Azionari		-
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		-

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
☑ Governativo	0,00
⚙ Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏛 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	0,00
📑 Derivati	0,00

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 %

	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 Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Lumyna Investments Limited	Patrimonio Classe (Mln)	0,16 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	100 EUR
Web	www.lumyna.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	2,10%
Data di Partenza	19/01/2018	UCITS	Si	Spese correnti	1,95%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	20,00%

Lumyna - Millburn Diversified UCITS Fund USD Z (acc)

Data Inizio Gestione	08/03/2017	ISIN	LU1696455077
NAV (03/02/2025)	USD 122,70		
Patrimonio Netto (Mln)	-		