

LO Funds - Global Government Fundamental Syst. Hdg (CHF) IA

Morningstar Medalist Rating™

Negative

Morningstar Categorie Index

Morningstar Global Core Bond
GR Hedged CHF

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Bloomberg Global Treasury TR
USD

Morningstar Rating™

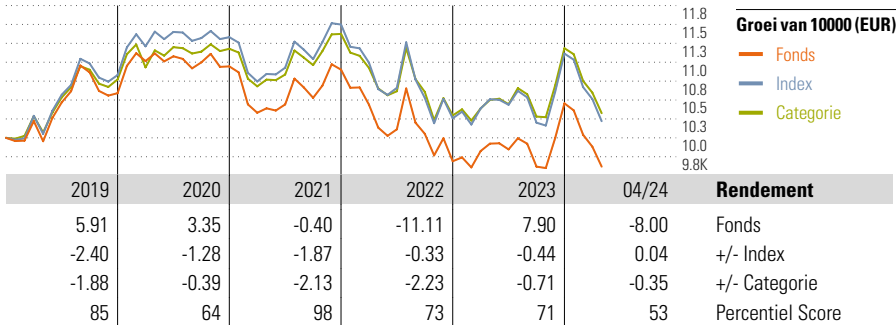
★★

Morningstar Categorie™

Obligaties Wereldwijd CHF
Hedged

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed. The Bloomberg Barclays Global Treasury TR index is used for performance comparison as well as internal risk monitoring purposes, without implying any particular constraints to the Sub-Fund's investments. Securities targeted by the Sub-Fund can be similar to those of the index to an extent that varies over time but their weighting is expected to differ materially. The performance of the Sub-Fund may deviate materially from that of the index.



Risicomaatstaven

Alpha	-1.12	Sharpe Ratio	-0.44
Beta	0.91	Std Deviatie	8.14
R-kwadraat	96.57	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	-0.49	5-jr Risico	- gem
Tracking Error	1.13	10-jr Risico	- gem

Berekeningen met Morningstar Gbl Core Bd GR Hdg CHF (waar van toepassing)

Rendementen (30 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-4.20	-0.58	-0.88
6 Maanden	-2.67	0.36	0.14
1 jaar	-3.39	-1.32	-2.41
3 jr gean.	-2.56	-0.83	-1.52
5 jr gean.	-1.24	-1.09	-1.08

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-5.49	-	-	-
2023	1.39	0.22	-2.32	8.70
2022	-4.24	-3.14	-0.59	-3.61
2021	-5.61	1.07	0.83	3.54
2020	4.01	0.57	-0.72	-0.49

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	111.30	8.56	102.73
Kas/ geldmarkt	7.04	9.78	-2.73
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	-
	Effectieve Looptijd	-
	Gem Krediet	AAA
	Kwaliteit	
Laag	Gem	Hoog
Laag	Gem	Hoog
Laag	Gem	Hoog

Kredietkwalite

it			
AAA	42.10	BBB	5.30
AA	47.60	BB	0.00
A	31.80	B	0.00
		Below B	0.00
		Geen Rating	-26.80

Data per 29 feb 2024

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
10 Year Treasury Note Future June...	8.58
United States Treasury Notes...	5.44
United States Treasury Notes...	4.39
United States Treasury Bonds...	4.01
2 Year Treasury Note Future June...	3.79
United States Treasury Bonds...	3.28
Japan (Government Of) 1.5%2033-03-20	3.17
United States Treasury Notes...	3.02
United States Treasury Notes...	2.99
Japan (Government Of) 1.9%2053-03-20	2.80
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	155
% Van Vermogen In Top 10 Posities	41.49

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	21.52
3 tot 5 jaar	17.06
5 tot 7 jaar	9.42
7 tot 10 jaar	13.44
10 tot 15 jaar	5.43
15 tot 20 jaar	7.03
20 tot 30 jaar	12.25
Meer dan 30 jaar	0.60

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	4.45
0% tot 4%	81.04
4% tot 6%	8.33
6% tot 8%	6.18
8% tot 10%	0.00
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Lombard Odier Funds...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1,000,000
Telefoon	00352 27 78 5000	Fondsvaluta	CHF	Min Additioneel	-
Website	www.loim.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	23 mei 2017	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Nic Hoogewijs	ISIN	LU1577885749		
Aanvangsdatum	15 jun 2015				
Koers (30 mei 2024)	CHF 22.20				
Fondsvermogen (mln)	CHF 0.03				