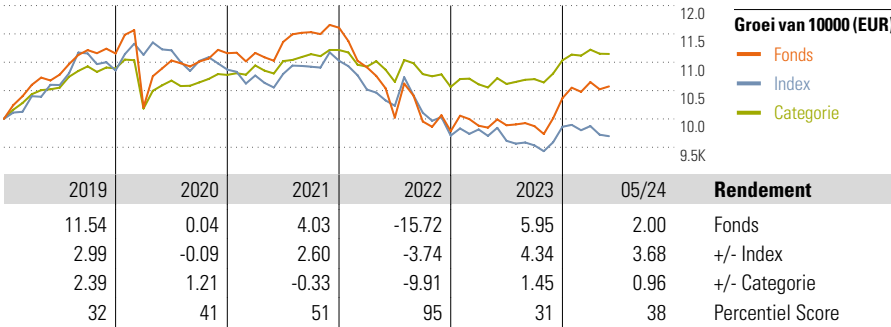


LO Funds - Global BBB-BB Fundamental (CHF) PA

Morningstar Medalist Rating™ Negative	Morningstar Categorie Index Morningstar Global Core Bond GR USD Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Bloomberg Gbl Agg 500 MM Corp TR Hdg EUR	Morningstar Rating™ ★★	Morningstar Categorie™ Global Flexible Bond
--	--	---	----------------------------------	---

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed. The Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporates 500MM 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	-	Sharpe Ratio	-0.33								
Beta	-	Std Deviatie	7.70								
R-kwadraat	-	3-jr Risico	Bov gem								
Informatie Ratio	0.34	5-jr Risico	Bov gem								
Tracking Error	3.95	10-jr Risico	Bov gem								
Berekeningen met Morningstar Gbl Core Bd GR USD (waar van toepassing)											

Rendementen (30 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
3 Maanden	0.94	2.01	0.48	2024	2.73	-	-	-
6 Maanden	6.85	5.74	3.61	2023	0.98	0.08	-0.16	5.01
1 jaar	6.41	7.90	2.53	2022	-6.01	-8.14	-0.68	-1.71
3 jr gean.	-1.47	1.32	-3.08	2021	0.04	1.75	1.52	0.68
5 jr gean.	-0.20	1.57	-1.35	2020	-8.50	8.08	-0.17	1.34

Portefeuille 29 feb 2024											
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™		Kredietkwalite it	% Oblg		% Oblg		
Aandelen	0.00	0.00	0.00		Tijdsduur	-	AAA	0.00	BBB	54.40	
Obligaties	147.37	118.55	28.83		Effectieve Looptijd	-	AA	0.00	BB	34.10	
Kas/ geldmarkt	24.52	38.61	-14.09		Gem Krediet	BB	A	8.60	B	0.60	
Overig	85.27	0.00	85.27		Kwaliteit				Below B	0.20	
									Geen Rating	2.10	
Data per 29 feb 2024											
Top 10 Onderliggende posities	% Port			Maturity-verdeling	% Oblg	Couponverdeling	% Oblg				
Trsbp Cofq Eu270324p-Trsbp Cofq...	33.24			1 tot 3 jaar	6.53	0% PIK	0.00				
10 Year Treasury Note Future June...	15.98			3 tot 5 jaar	10.30	0% tot 4%	42.47				
Trsbp Cofr Us270324p-Trsbp Cofr...	15.35			5 tot 7 jaar	13.17	4% tot 6%	37.04				
Trsct Cog6 Eu270324p-Trsct Cog6...	13.04			7 tot 10 jaar	9.84	6% tot 8%	14.70				
Trsct Cog5 Eu270324p-Trsct Cog5...	13.01			10 tot 15 jaar	4.56	8% tot 10%	5.23				
Ultra US Treasury Bond Future June...	8.41			15 tot 20 jaar	2.63	10% tot 12%	0.56				
Trsct Cog8 Us270324p-Trsct Cog8...	4.82			20 tot 30 jaar	6.07	Meer dan 12%	0.00				
Trsct Cog9 Us270324p-Trsct Cog9...	4.82			Meer dan 30 jaar	11.24						
Euro Bund Future Mar 242024-03-07	3.54										
NatWest Group PLC 6.475%2034-06-01	0.95										
Totaal Aantal Aandelen	0										
Totaal Aantal Obligaties	995										
% Van Vermogen In Top 10 Posities	113.16										

Fondsinformatie					
Fondsgroep	Lombard Odier Funds...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	3,000
Telefoon	00352 27 78 5000	Fondsvaluta	CHF	Min Additioneel	-
Website	www.loim.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	6 nov 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ashton Parker	ISIN	LU0798463336		
Aanvangsdatum	31 okt 2016				
Koers (30 mei 2024)	CHF 9.94				
Fondsvermogen (mln)	CHF 0.09				