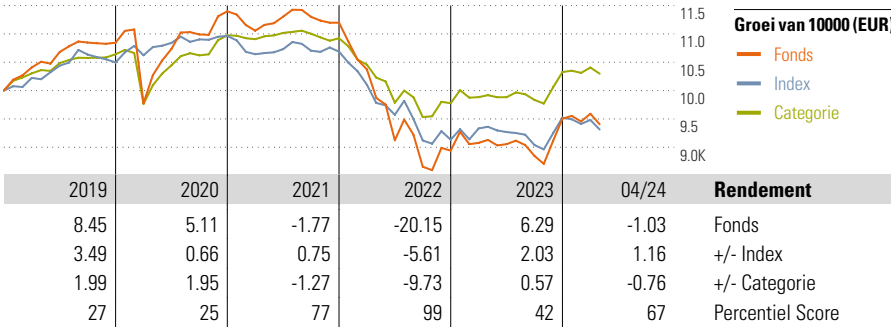


LO Funds - Global BBB-BB Fundamental Syst. Hdg (EUR) PA

Morningstar Medalist Rating™ Negative	Morningstar Categorie Index Morningstar Global Core Bond GR Hedged EUR 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 - EUR Hedged
--	---	---	---------------------------------	---

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	1.07	Sharpe Ratio	-0.73
Beta	1.36	Std Deviatie	9.12
R-kwadraat	81.08	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	-0.26	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	4.45	10-jr Risico	-
Berekeningen met Morningstar Gbl Core Bd GR Hdg EUR (waar van toepassing)			

Rendementen (16 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	1.74	1.32	0.62
6 Maanden	6.78	4.16	2.45
1 jaar	6.24	5.08	1.36
3 jr gean.	-4.77	-0.83	-2.74
5 jr gean.	-1.76	-0.10	-1.73

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	0.93	-	-	-
2023	1.53	-0.24	-2.30	7.42
2022	-7.36	-12.05	-5.12	3.29
2021	-3.01	2.25	-0.05	-0.90
2020	-9.82	9.76	2.39	3.72

Portefeuille 31 jan 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	160.55	155.40	5.16
Kas/ geldmarkt	31.73	20.47	11.26
Overig	83.58	0.00	83.58

Morningstar Vastrentende Style Box™			
	Tijdsduur	-	
	Effectieve Looptijd	-	
	Gem Krediet	BB	
	Kwaliteit		
Laag Gem Hoog Kredietkwaliteit Laag Gem Hoog Rentegevoeligheid			

Kredietkwalite it	% Oblg	% Oblg
AAA	0.00	BBB 54.50
AA	0.00	BB 33.10
A	9.00	B 0.80
		Below B 0.20
		Geen Rating 2.40

Data per 31 jan 2024

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Trsbp Cofq Eu270324p-Trsbp Cofq...	32.60
10 Year Treasury Note Future Mar...	17.47
Trsbp Cofr Us270324p-Trsbp Cofr...	15.01
Trsct Cog6 Eu270324p-Trsct Cog6...	12.80
Trsct Cog5 Eu270324p-Trsct Cog5...	12.77
Ultra US Treasury Bond Future Mar...	8.55
Trsct Cog8 Us270324p-Trsct Cog8...	4.72
Trsct Cog9 Us270324p-Trsct Cog9...	4.72
Euro Bund Future Mar 242024-03-07	2.46
2 Year Treasury Note Future Mar...	0.70
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	1020
% Van Vermogen In Top 10 Posities	111.80

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	6.09
3 tot 5 jaar	9.56
5 tot 7 jaar	11.43
7 tot 10 jaar	9.49
10 tot 15 jaar	3.64
15 tot 20 jaar	2.39
20 tot 30 jaar	5.82
Meer dan 30 jaar	10.19

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	0.00
0% tot 4%	44.69
4% tot 6%	36.89
6% tot 8%	13.26
8% tot 10%	5.17
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Lombard Odier Funds...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	3,000
Telefoon	00352 27 78 5000	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.loim.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	5 dec 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ashton Parker	ISIN	LU0798465893		
Aanvangsdatum	31 okt 2016				
Koers (16 mei 2024)	EUR 11.08				
Fondsvermogen (mln)	EUR 0.76				