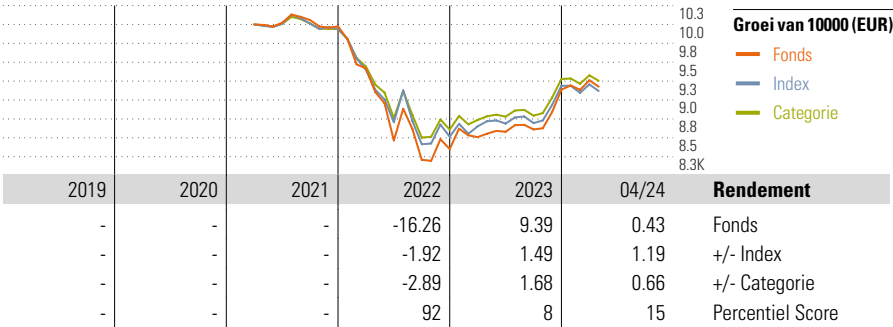


LO Funds - TargetNetZero Euro IG Corporate ND

Morningstar Medalist Rating™ Neutral	Morningstar Categorie Index Morningstar Eurozone Corporate Bond GR EUR Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Bloomberg Euro Corp TR EUR	Morningstar Rating™ ★★★	Morningstar Categorie™ Obligaties Euro Bedrijven
---	---	--	-----------------------------------	--

Beleggingsdoelstelling

A Sub-Fund at least 75% invested in bonds, fixed or floating-rate securities and short-term securities denominated in euros. The Investment Manager shall invest at least 75% of the Sub-Fund in securities graded at least BBB or equivalent. The Directors have authorised the Investment Manager to invest up to 25% of the Sub-Fund in securities graded below BBB. The Investment Manager will use its discretion with regard to the selection of markets and currencies. The Sub-Fund faces investment risks greater than those...



Risicomaatstaven			
Alpha	0.53	Sharpe Ratio	-0.53
Beta	1.07	Std Deviatie	7.50
R-kwadraat	90.06	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	0.07	5-jr Risico	-
Tracking Error	2.36	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar EZN Corp Bd GR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (30 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.89	0.48	-1.00
6 Maanden	4.22	2.02	0.22
1 jaar	7.54	2.94	0.73
3 jr gean.	-2.59	0.28	-0.52
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.36	-	-	-
2023	1.89	0.82	0.37	6.10
2022	-5.56	-10.12	-3.02	1.74
2021	-	-	0.35	-0.84

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	121.34	26.16	95.18
Kas/ geldmarkt	2.06	34.28	-32.22
Overig	37.03	0.00	37.03

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

Kredietkwaliteit	% Oblg	% Oblg
AAA	0.00	BBB 77.80
AA	0.00	BB 8.90
A	11.50	B 0.00
		Below B 0.00
		Geen Rating 1.80

Data per 29 feb 2024

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Trsbp Cofq Eu270324p-Trsbp Cofq...	25.23
Euro Bund Future Mar 242024-03-07	13.03
Trsbp Cofr Us270324p-Trsbp Cofr...	11.66
Drax Finco Plc 2.625%2025-11-01	2.47
Infineon Technologies AG 2.875%2099-10-0	2.36
Commerzbank AG 4%2030-12-05	2.33
AIB Group PLC 2.875%2031-05-30	2.30
Lloyds Banking Group PLC 4.5%2030-03-18	2.25
ELM BV 2.6%2049-04-02	1.96
Telefonica Europe B V 2.502%2099-02-05	1.88
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	134
% Van Vermogen In Top 10 Posities	65.48

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	9.15
3 tot 5 jaar	10.08
5 tot 7 jaar	18.61
7 tot 10 jaar	13.98
10 tot 15 jaar	2.02
15 tot 20 jaar	0.90
20 tot 30 jaar	8.89
Meer dan 30 jaar	17.41

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	0.00
0% tot 4%	83.09
4% tot 6%	15.87
6% tot 8%	1.04
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	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.loim.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	28 mei 2009	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Ashton Parker	ISIN	LU0210004932		
Aanvangsdatum	31 okt 2016				
Koers (30 mei 2024)	EUR 13.91				
Fondsvermogen (mln)	EUR 0.40				