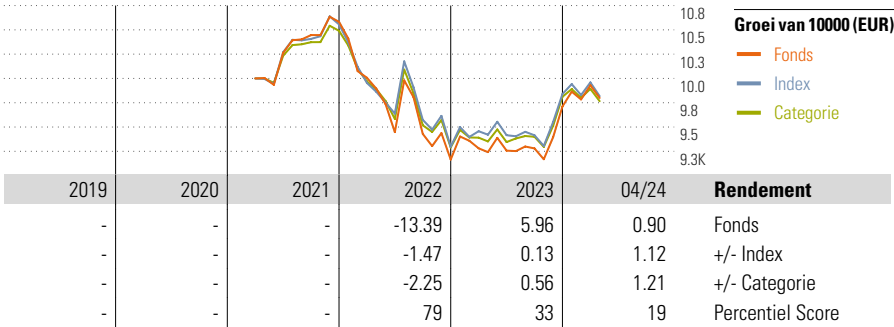


LO Funds - TargetNetZero Global IG Corporate (USD) NA

Morningstar Medalist Rating™ Neutral	Morningstar Categorie Index Morningstar Global Corporate Bond GR USD Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Bloomberg Gbl Agg Corp TR EUR	Morningstar Rating™ —	Morningstar Categorie™
---	---	---	---------------------------------	-------------------------------

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed. The Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporates TR index is used to define the initial investment universe for individual security selection, for performance comparison as well as for internal risk monitoring purposes, without implying any particular constraints to the Sub-Fund's investments. The Sub-Fund's securities will generally be similar to those of the above-mentioned index but the security weightings are expected to differ materially. The Investment Manager may also select...



Risicomaatstaven			
Alpha	-0.13	Sharpe Ratio	-0.25
Beta	0.99	Std Deviatie	7.00
R-kwadraat	96.51	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-0.05	5-jr Risico	-
Tracking Error	1.84	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar Gbl Corp Bd GR USD (waar van toepassing)

Rendementen (2 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
3 Maanden	-0.24	0.31	-0.15	2024	2.23	-	-	-
6 Maanden	6.31	1.32	1.00	2023	1.26	-0.26	0.25	4.65
1 jaar	6.24	1.70	0.32	2022	-5.43	-5.59	-0.20	-2.80
3 jr gean.	-0.52	-0.13	-0.51	2021	-	-	1.78	1.30
5 jr gean.	-	-	-					

Portefeuille 31 jan 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	122.69	35.27	87.42
Kas/ geldmarkt	15.12	28.52	-13.40
Overig	25.98	0.00	25.98

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

Kredietkwaliteit	% Oblg	% Oblg
AAA	0.00	BBB 70.00
AA	0.00	BB 10.60
A	16.30	B 0.00
		Below B 0.00
		Geen Rating 3.10

Data per 31 jan 2024

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Trsbp Cofq Eu270324p-Trsbp Cofq...	17.69
Trsbp Cofr Us270324p-Trsbp Cofr...	8.14
Ultra US Treasury Bond Future Mar...	6.81
Euro Bund Future Mar 242024-03-07	2.96
5 Year Treasury Note Future Mar...	2.32
Iron Mountain Inc. 4.5%2031-02-15	1.18
Phoenix Group Holdings PLC 4.75%2031-09-(	1.09
Stora Enso Oyj 7.25%2036-04-15	1.03
Dominion Energy Inc 3.375%2030-04-01	1.03
Morgan Stanley 3.95%2027-04-23	0.92
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	322
% Van Vermogen In Top 10 Posities	43.16

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	9.68
3 tot 5 jaar	10.27
5 tot 7 jaar	13.68
7 tot 10 jaar	13.99
10 tot 15 jaar	5.98
15 tot 20 jaar	2.18
20 tot 30 jaar	10.16
Meer dan 30 jaar	12.56

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	0.00
0% tot 4%	59.50
4% tot 6%	27.58
6% tot 8%	11.08
8% tot 10%	1.84
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	USD	Min Additioneel	-
Website	www.loim.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	19 dec 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ashton Parker	ISIN	LU0857975659		
Aanvangsdatum	31 okt 2016				
Koers (2 mei 2024)	USD 10.13				
Fondsvermogen (mln)	USD 0.02				