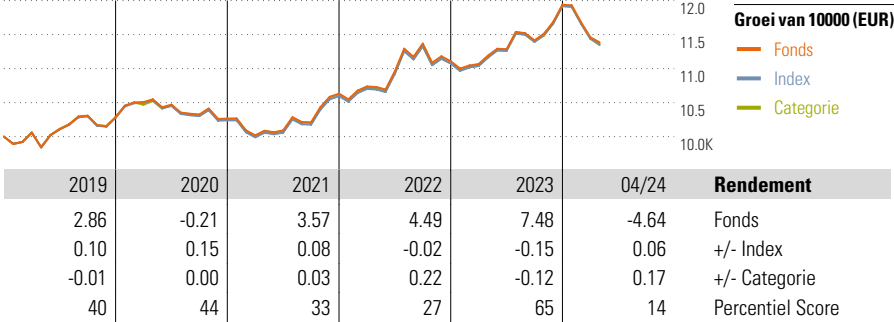


# LO Funds - Short-Term Money Market (CHF) ND

| Morningstar Categorie Index                 | Benchmark van het fonds    | Morningstar Rating™ | Morningstar Categorie™ |
|---------------------------------------------|----------------------------|---------------------|------------------------|
| Morningstar Swiss Franc 1-Month Cash GR CHF | FTSE CHF EuroDep 1 Mon CHF | —                   | Geldmarkt CHF          |
| Wordt gebruikt in dit rapport als index     |                            |                     |                        |

**Beleggingsdoelstelling**

The Sub-Fund invests in bank deposits, money market instruments and short-term debt instruments (e.g. ECP, T-Bills, CDs) and other fixed- or variable-rate securities, denominated in OECD currencies and/or Emerging Market currencies, with the objective to provide a return in line with money market rates. The entire portfolio of the Sub-Fund may not have a WAL of more than 120 days. Instruments are of high quality and may have a maximum residual maturity of 397 days. The WAM of the portfolio is no more than 60 days. Up...



| Risicomaatstaven                                                      | Rendementen (3 mei 2024) | Rend % | +/-Idx | +/-Cat | Kwartaalrendementen | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|-----------------------------------------------------------------------|--------------------------|--------|--------|--------|---------------------|-------|-------|-------|-------|
| Alpha - Sharpe Ratio 0.60                                             | 3 Maanden                | -3.61  | 0.05   | 0.04   | 2024                | -4.01 | -     | -     | -     |
| Beta - Std Deviatie 4.61                                              | 6 Maanden                | -0.20  | 0.05   | 0.06   | 2023                | -0.37 | 1.97  | 1.15  | 4.59  |
| R-kwadraat - 3-jr Risico -                                            | 1 jaar                   | 2.23   | -0.03  | 0.06   | 2022                | 1.00  | 2.08  | 3.72  | -2.29 |
| Informatie Ratio -0.40 5-jr Risico -                                  | 3 jr gean.               | 4.38   | -0.03  | 0.00   | 2021                | -2.40 | 0.71  | 1.19  | 4.12  |
| Tracking Error 0.05 10-jr Risico -                                    | 5 jr gean.               | 3.03   | 0.04   | 0.01   | 2020                | 2.15  | -0.35 | -1.40 | -0.57 |
| Berekeningen met Morningstar CHF 1M Cash GR CHF (waar van toepassing) |                          |        |        |        |                     |       |       |       |       |

**Portefeuille 31 jan 2024**

| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto | Morningstar Vastrentende Style Box™                                                                                                             | Kredietkwaliteit    | % Oblg | % Oblg |             |        |      |
|----------------|--------|---------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|--------|--------|-------------|--------|------|
| Aandelen       | 0.00   | 0.00    | 0.00    | <div><div>Laag</div><div>Gem</div><div>Hoog</div><div>Laag</div><div>Med</div><div>Hoog</div><div>Laag</div><div>Med</div><div>Hoog</div></div> | Tijdsduur           | -      | it     |             |        |      |
| Obligaties     | 7.47   | 0.00    | 7.47    |                                                                                                                                                 | Effectieve Looptijd | -      | AAA    | 0.00        | BBB    | 0.00 |
| Kas/ geldmarkt | 143.92 | 51.39   | 92.53   |                                                                                                                                                 | Gem Krediet         | B      | AA     | 0.00        | BB     | 0.00 |
| Overig         | 0.00   | 0.00    | 0.00    |                                                                                                                                                 | Kwaliteit           |        | A      | 0.00        | B      | 0.00 |
|                |        |         |         | Rentegevoeligheid                                                                                                                               |                     |        |        | Below B     | 0.00   |      |
|                |        |         |         |                                                                                                                                                 |                     |        |        | Geen Rating | 100.00 |      |

**Top 10 Onderliggende posities**

|                                            | % Port |
|--------------------------------------------|--------|
| SWISS FRANC                                | 13.66  |
| Batigere-Nancy (Societe Anonyme...         | 4.52   |
| EUR/CHF 20240205 - 125372024-02-05         | 4.51   |
| Batigere-Nancy (Societe Anonyme...         | 4.50   |
| Halkin Finance plc 0%2024-03-28            | 4.45   |
| Arabella Finance Designated Activity Co... | 3.88   |
| Bayerische Landesbank 0%2024-02-27         | 3.88   |
| Mizuho Bank, Ltd. London Branch...         | 3.61   |
| Vilogia Societe Anonyme d'HLM...           | 2.91   |
| Swiss National Bank 0%2024-02-05           | 2.91   |
| Totaal Aantal Aandelen                     | 0      |
| Totaal Aantal Obligaties                   | 8      |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities          | 48.83  |

**Maturity-verdeling**

|                  | % Oblg |
|------------------|--------|
| 1 tot 3 jaar     | 0.00   |
| 3 tot 5 jaar     | 0.00   |
| 5 tot 7 jaar     | 0.00   |
| 7 tot 10 jaar    | 0.00   |
| 10 tot 15 jaar   | 0.00   |
| 15 tot 20 jaar   | 0.00   |
| 20 tot 30 jaar   | 0.00   |
| Meer dan 30 jaar | 0.00   |

**Couponverdeling**

|              | % Oblg |
|--------------|--------|
| 0% PIK       | 0.00   |
| 0% tot 4%    | 100.00 |
| 4% tot 6%    | 0.00   |
| 6% tot 8%    | 0.00   |
| 8% tot 10%   | 0.00   |
| 10% tot 12%  | 0.00   |
| Meer dan 12% | 0.00   |

Data per 31 jan 2024

| 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    | 3 okt 2014             | Inc/Acc        | Inc          |                    |           |
| Fondsmanager        | Ashton Parker          | ISIN           | LU0995143889 |                    |           |
| Aanvangsdatum       | 26 feb 2016            |                |              |                    |           |
| Koers (3 mei 2024)  | CHF 123.05             |                |              |                    |           |
| Fondsvermogen (mln) | CHF 40.40              |                |              |                    |           |

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.