

LO Funds - All Roads Conservative Syst. Hdg (CHF) SA

Morningstar Categorie Index

Cat 75%Citi SwissGBI&25%MSCI Wld
Free NR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Mixfondsen CHF Defensief

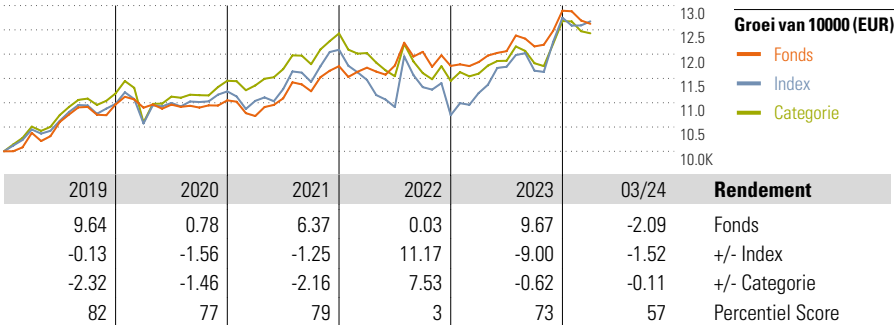
Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed. The Sub-Fund is not managed in reference to an index. The Sub-Fund implements an asset allocation strategy in bonds, other fixed or floating-rate debt securities and short-term debt instruments issued or guaranteed by sovereign or non-sovereign issuers, convertible bonds, equities, currencies and/or Cash and Cash Equivalents, denominated in OECD currencies and/or Emerging Market currencies, including CNH and CNY. The instruments described above may be of any credit quality (including...

Risicomaatstaven

Alpha	0.85	Sharpe Ratio	0.78
Beta	0.25	Std Deviatie	5.58
R-kwadraat	54.30	3-jr Risico	Laag
Informatie Ratio	0.13	5-jr Risico	Laag
Tracking Error	6.38	10-jr Risico	-

Berekeningen met Cat 75%Citi SwissGBI&25%MSCI Wld Free NR (waar van toepassing)



Rendementen (16 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-1.40	-1.01	0.46
6 Maanden	1.65	-3.40	-1.34
1 jaar	5.17	-4.69	1.84
3 jr gean.	4.92	1.06	2.89
5 jr gean.	4.22	0.40	0.89

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-2.09	-	-	-
2023	0.68	1.90	0.81	6.05
2022	-0.27	0.37	2.40	-2.41
2021	-2.92	3.39	1.31	4.60
2020	-0.60	0.58	-0.55	1.37

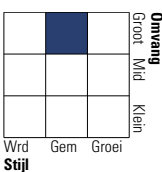
Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling

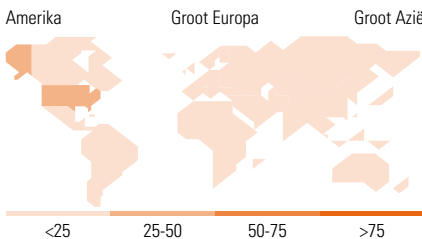
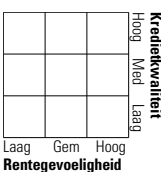
	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	22.03	6.11	15.92
Obligaties	54.84	20.01	34.84
Kas/ geldmarkt	66.74	30.98	35.76
Overig	13.49	0.00	13.49

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Trsbp Cpbc Us310524p-Trsbp...	—	4.61
JGB LT FUTURE MAR242024-03-13	—	4.37
MSCI E/M FUT MAR242024-03-15	—	3.26
Codeis Securities 0%2050-10-12	—	2.90
Trssg Cqwi Us230924p-Trssg...	—	2.87
Long Gilt Future June...	—	2.45
TRSSG CRKE EU311024P-TRSSG...	—	2.23
Long-Term Euro BTP Future Mar...	—	2.22
TRSSG CRKF US311024P-TRSSG...	—	2.22
Kospi 200 Fut Mar242024-03-14	—	1.97
Totaal Aantal Aandelen		196
Totaal Aantal Obligaties		81
% Van Vermogen In Top 10 Posities		29.11

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	31.61
Basismaterialen	3.73
Cyclische consumentenproducten	11.80
Financiële dienstverlening	14.56
Vastgoed	1.52
Licht Cyclisch	48.47
Communicatiediensten	7.11
Energie	4.12
Industrie	11.91
Technologie	25.33
Defensief	19.92
Defensieve consumptiegoederen	6.51
Gezondheidszorg	11.78
Nutsbedrijven	1.63

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	51.28
Verenigde Staten	48.63
Canada	2.39
Latijns Amerika	0.26
Groot Europa	34.47
Verenigd Koninkrijk	5.44
West Europa – Euro	23.61
West Europa – Niet Euro	5.41
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.01
Groot Azië	14.25
Japan	9.72
Australazië	4.52
Azië - Ontwikkeld	0.01
Azië - Emerging	0.01

Fondsinformatie

Fondsgroep	Lombard Odier Funds...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	00352 27 78 5000	Fondsvaluta	CHF	Min Additioneel	-
Website	www.loim.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	17 jan 2017	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Sui Kai Wong	ISIN	LU1514038162		
Aanvangsdatum	17 jan 2017				
Koers (16 apr 2024)	CHF 10.99				
Fondsvermogen (mln)	CHF 277.93				