

LO Funds - Short-Term Money Market (CHF) IA

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...

	2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Rendement
Fonds	2.86	-0.21	3.57	4.49	7.48	-4.64	Fonds
Index	0.10	0.15	0.08	-0.02	-0.15	0.06	+/- Index
Categorie	-0.01	0.00	0.03	0.22	-0.12	0.17	+/- Categorie
Percentiel Score	40	44	31	26	64	15	

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
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	7.47	0.00	7.47
Kas/ geldmarkt	143.92	51.39	92.53
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

			Kredietkwaliteit Hoog Med Laag Laag Gem Hoog Rentegevoeligheid	Tijdsduur	-
				Effectieve Looptijd	-
				Gem Krediet	B
				Kwaliteit	

Kredietkwaliteit

% Oblg	% Oblg	
AAA	0.00 BBB	0.00
AA	0.00 BB	0.00
A	0.00 B	0.00
	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

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	5 feb 2019	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ashton Parker	ISIN	LU1577895896		
Aanvangsdatum	26 feb 2016				
Koers (3 mei 2024)	CHF 124.97				
Fondsvermogen (mln)	CHF 104.77				