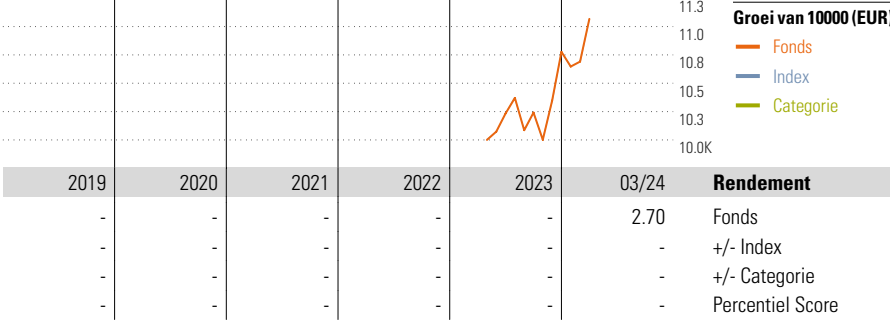


# LO Funds - All Roads Syst. NAV Hdg (AUD) NA

|                             |                         |                     |                        |
|-----------------------------|-------------------------|---------------------|------------------------|
| Morningstar Categorie Index | Benchmark van het fonds | Morningstar Rating™ | Morningstar Categorie™ |
| —                           | Not Benchmarked         | —                   | Mixfondsen Overig      |

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 |                |   | Rendementen (18 apr 2024) | Rend % | +/-Idx | +/-Cat | Kwartaalrendementen | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|------------------|----------------|---|---------------------------|--------|--------|--------|---------------------|-------|-------|-------|-------|
| Alpha            | - Sharpe Ratio | - | 3 Maanden                 | 5.24   | -      | -      | 2024                | 2.70  | -     | -     | -     |
| Beta             | - Std Deviatie | - | 6 Maanden                 | 8.66   | -      | -      | 2023                | -     | -     | 0.07  | 5.23  |
| R-kwadraat       | - 3-jr Risico  | - | 1 jaar                    | 6.74   | -      | -      |                     |       |       |       |       |
| Informatie Ratio | - 5-jr Risico  | - | 3 jr gean.                | -      | -      | -      |                     |       |       |       |       |
| Tracking Error   | - 10-jr Risico | - | 5 jr gean.                | -      | -      | -      |                     |       |       |       |       |

Portefeuille 31 dec 2023

Assetverdeling

|                | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 31.79  | 4.65    | 27.13   |
| Obligaties     | 2.01   | 0.37    | 1.64    |
| Kas/ geldmarkt | 8.35   | 6.58    | 1.77    |
| Overig         | 69.82  | 0.37    | 69.45   |

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen

|       |     |       |        |
|-------|-----|-------|--------|
|       |     |       | Onverw |
|       |     |       | Groot  |
|       |     |       | Mid    |
|       |     |       | Klein  |
| Wrd   | Gem | Groei |        |
| Stijl |     |       |        |

Stijl vastrentend

|                   |     |      |                  |
|-------------------|-----|------|------------------|
|                   |     |      | Kredietkwaliteit |
|                   |     |      | Hoog             |
|                   |     |      | Med              |
|                   |     |      | Laag             |
| Laag              | Gem | Hoog |                  |
| Rentegevoeligheid |     |      |                  |

Amerika

Groot Europa

Groot Azië

| Top 10 Onderliggende posities     |                                                                                     |       | Sector                                                                              | % Port                         | Sectorverdeling | % Aand       | Regioverdeling          | % Aand       |
|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|-------|-------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|--------------|-------------------------|--------------|
| Csa St Mm Eur-Qa079500            | —                                                                                   | 69.43 |  | <b>Cyclisch</b>                |                 | <b>32.93</b> | <b>Amerika</b>          | <b>48.60</b> |
| Msci E/M Fut Mar242024-03-15      | —                                                                                   | 2.13  |  | Basismaterialen                |                 | 4.07         | Verenigde Staten        | 45.35        |
| KOSPI 200 FUT MAR242024-03-14     | —                                                                                   | 1.96  |  | Cyclische consumentenproducten |                 | 12.57        | Canada                  | 3.01         |
| TOPIX Dividend Index...           | —                                                                                   | 1.38  |  | Financiële dienstverlening     |                 | 14.84        | Latijns Amerika         | 0.23         |
| Hang Seng Fut Jan242024-01-30     | —                                                                                   | 1.35  |  | Vastgoed                       |                 | 1.45         |                         |              |
|                                   |                                                                                     |       |                                                                                     |                                |                 |              |                         |              |
| Microsoft Corp                    |  | 0.95  |  | <b>Licht Cyclisch</b>          |                 | <b>47.37</b> | <b>Groot Europa</b>     | <b>36.60</b> |
| Emini Russ 2000 Fut...            | —                                                                                   | 0.81  |  | Communicatiediensten           |                 | 7.45         | Verenigd Koninkrijk     | 5.85         |
| SGX FTSE TAIWAN FUT...            | —                                                                                   | 0.81  |  | Energie                        |                 | 3.38         | West Europa – Euro      | 24.63        |
| Apple Inc                         |  | 0.81  |  | Industrie                      |                 | 11.36        | West Europa – Niet Euro | 6.13         |
| SCN JAN24 FUTURE2024-01-30        | —                                                                                   | 0.63  |  | Technologie                    |                 | 25.18        | Emerging Europa         | 0.00         |
|                                   |                                                                                     |       |                                                                                     |                                |                 |              |                         |              |
| Totaal Aantal Aandelen            |                                                                                     | 198   |  | <b>Defensief</b>               |                 | <b>19.70</b> | Midden-Oosten / Afrika  | 0.00         |
| Totaal Aantal Obligaties          |                                                                                     | 13    |  | Defensieve consumptiegoederen  |                 | 6.56         | <b>Groot Azië</b>       | <b>14.80</b> |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities |                                                                                     | 80.25 |  | Gezondheidszorg                |                 | 11.78        | Japan                   | 9.66         |
|                                   |                                                                                     |       |  | Nutsbedrijven                  |                 | 1.36         | Australazië             | 5.14         |
|                                   |                                                                                     |       |                                                                                     |                                |                 |              | Azië - Ontwikkeld       | 0.00         |
|                                   |                                                                                     |       |                                                                                     |                                |                 |              | Azië - Emerging         | 0.00         |

|                     |                        |                |              |                    |           |
|---------------------|------------------------|----------------|--------------|--------------------|-----------|
| Fondsinformatie     |                        |                |              |                    |           |
| Fondsgroep          | Lombard Odier Funds... | Vestigingsland | Luxemburg    | Min Aanvangsbedrag | 1,000,000 |
| Telefoon            | 00352 27 78 5000       | Fondsvaluta    | AUD          | Min Additioneel    | -         |
| Website             | www.loim.com           | UCITS          | ja           |                    |           |
| Oprichtingsdatum    | 7 aug 2019             | Inc/Acc        | Acc          |                    |           |
| Fondsmanager        | Sui Kai Wong           | ISIN           | LU2034326582 |                    |           |
| Aanvangsdatum       | 31 jul 2014            |                |              |                    |           |
| Koers (18 apr 2024) | AUD 11.53              |                |              |                    |           |
| Fondsvermogen (mln) | AUD 8.91               |                |              |                    |           |

© 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 licentievooraarden, (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.