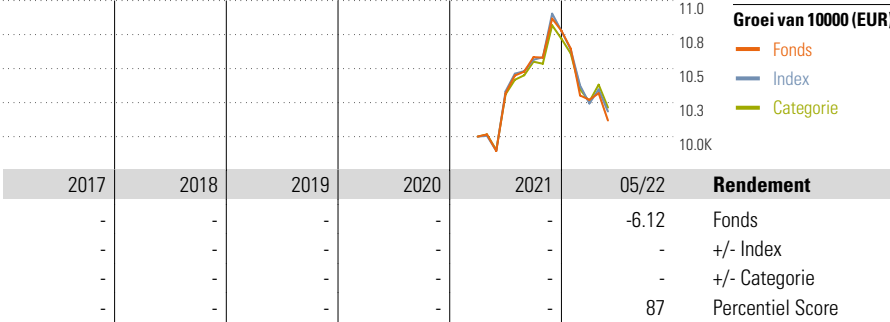


LO Funds - TargetNetZero Global IG Corporate Syst. Multi Ccy Hdg (USD) IA

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

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	Rendementen (3 jun 2022)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Alpha	- Sharpe Ratio	-	-	-	2022	-4.71	-	-	-
Beta	- Std Deviatie	-	-	-	2021	-	-	2.57	1.83
R-kwadraat	- 3-jr Risico	-	-	-					
Informatie Ratio	- 5-jr Risico	-	-	-					
Tracking Error	- 10-jr Risico	-	-	-					

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

Portefeuille 31 jan 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™	Kredietkwalite it	% Oblg	% Oblg
Aandelen	0.00	0.00	0.00	Tijdsduur	-		
Obligaties	122.69	35.27	87.42	Effectieve Looptijd	-	AAA	0.00 BBB 70.00
Kas/ geldmarkt	15.12	28.52	-13.40	Gem Krediet	BBB	AA	0.00 BB 10.60
Overig	25.98	0.00	25.98	Kwaliteit		A	16.30 B 0.00

Laag Gem Hoog
Rentegevoeligheid

Top 10 Onderliggende posities	% Port	Maturity-verdeling	% Oblg	Couponverdeling	% Oblg
Trsbp Cofq Eu270324p-Trsbp Cofq...	17.69	1 tot 3 jaar	9.68	0% PIK	0.00
Trsbp Cofr Us270324p-Trsbp Cofr...	8.14	3 tot 5 jaar	10.27	0% tot 4%	59.50
Ultra US Treasury Bond Future Mar...	6.81	5 tot 7 jaar	13.68	4% tot 6%	27.58
Euro Bund Future Mar 242024-03-07	2.96	7 tot 10 jaar	13.99	6% tot 8%	11.08
5 Year Treasury Note Future Mar...	2.32	10 tot 15 jaar	5.98	8% tot 10%	1.84
Iron Mountain Inc. 4.5%2031-02-15	1.18	15 tot 20 jaar	2.18	10% tot 12%	0.00
Phoenix Group Holdings PLC 4.75%2031-09-(	1.09	20 tot 30 jaar	10.16	Meer dan 12%	0.00
Stora Enso Oyj 7.25%2036-04-15	1.03	Meer dan 30 jaar	12.56		
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				

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	21 jun 2018	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ashton Parker	ISIN	LU1577884429		
Aanvangsdatum	31 okt 2016				
Koers (3 jun 2022)	USD 10.79				
Fondsvermogen (mln)	-				