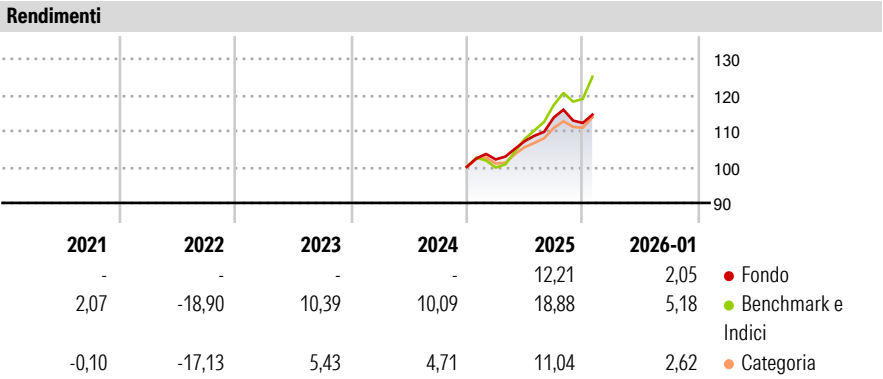


LO Funds - Convertible Bond (EUR) ND

|   |  |                                |                            |
|---|--|--------------------------------|----------------------------|
| <b>Categoria Morningstar™</b>                     | <b>Benchmark Morningstar</b>                       | <b>Benchmark Dichiarato</b>    | <b>Morningstar Rating™</b> |
| Obbligazionari Convertibili Globale - Euro Hedged | Refinitiv Global Hedged CB TR EUR Usato nel Report | Refinitiv Global Hgd CB TR EUR | ★★★                        |

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

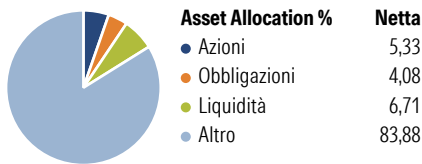
Investe in obbligazioni convertibili, warrants e azioni convertibili privilegiate denominate in diverse monete.



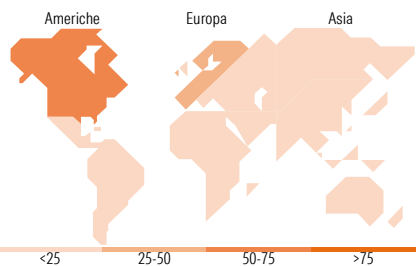
| Misure di Rischio  |       |                 |      |
|--|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha   | -2,83 | 3Y Sharpe Ratio | 0,64 |
| 3Y Beta  | 0,73  | 3Y Std Dev      | 6,66 |
| 3Y R-Squared   | 84,14 | 3Y Risk         | Med  |
| 3Y Info Ratio  | -1,67 | 5Y Risk         | -Med |
| 3Y Tracking Error  | 3,49  | 10Y Risk        | -Med |
| Basati su Refinitiv Global Hedged CB TR EUR (dove applicabile) |       |                 |      |

| Rend. Cumulati %                    | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti           | Q1   | Q2   | Q3   | Q4    |
|-------------------------------------|-------|-------|-------|----------------------|------|------|------|-------|
| 3-Mesi                              | 0,21  | 5,26  | 2,49  | <b>Trimestrali %</b> |      |      |      |       |
| 6-Mesi                              | 5,29  | 15,08 | 7,39  | 2026                 | -    | -    | -    | -     |
| 1-Anno                              | 10,94 | 22,49 | 10,72 | 2025                 | 2,07 | 4,99 | 6,11 | -1,32 |
| 3-Anni Ann.ti                       | 7,15  | 13,46 | 6,72  | 2024                 | -    | -    | -    | -     |
| 5-Anni Ann.ti                       | 0,60  | 3,38  | 0,14  | 2023                 | -    | -    | -    | -     |
| 10-Anni Ann.ti                      | 3,00  | 8,33  | 3,15  | 2022                 | -    | -    | -    | -     |
| Rendimenti aggiornati al 09/02/2026 |       |       |       |                      |      |      |      |       |

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo |
|-------------------------|-------|
| Duration Effettiva      | -     |
| Maturity effettiva      | -     |
| Qualità Credito Media   | B     |
| Qualità Credito         |       |
| Alto                    |       |
| Med                     |       |
| Basso                   |       |
| Sensibilità ai Tassi    |       |
| Bassa                   |       |
| Med                     |       |
| Alta                    |       |



| Titoli principali                           |         |       |
|---|---------|-------|
| Nome  | Settore | %     |
| Duke Energy Corp 4.125%                     | —       | 3,05  |
| Baidu Inc. 0%                               | —       | 2,94  |
| Delivery Hero SE 1.5%                       | —       | 2,86  |
| Southern Co. 4.5%                           | —       | 2,76  |
| Iberdrola Finanzas S.A.U. 1.5%              | —       | 1,59  |
| Centerpoint Energy Inc 4.25%                | —       | 1,46  |
| Alibaba Group Holding Ltd. 0%               | —       | 1,40  |
| Option On Cms Energy Corp                   | —       | 1,36  |
| Akamai Technologies, Inc....                | —       | 1,34  |
| 1.25 % Schneider 33 Cv                      | —       | 1,32  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 20,08 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 22    |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 8     |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|----------------------------------|-------|
| Governativo                      | 0,00  |
| Societario                       | 92,91 |
| Cartolarizzazioni                | 0,00  |
| Enti Locali                      | 0,00  |
| Liquidità ed equivalenti         | 5,91  |
| Derivati                         | 1,18  |
| Coupon Range %                   | Fondo |
| 0 coupon                         | 34,87 |
| Da 0 a 4 cedole                  | 54,90 |
| Da 4 a 6 cedole                  | 10,12 |
| Da 6 a 8 cedole                  | 0,11  |
| Da 8 a 10 cedole                 | 0,00  |
| Da 10 a 12 cedole                | 0,00  |
| Oltre 12 cedole                  | 0,00  |

| Ripartizione Geografica %     | Fondo        |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>60,63</b> |
| Stati Uniti                   | 60,63        |
| Canada                        | 0,00         |
| America Latina e Centrale     | 0,00         |
| <b>Europa</b>                 | <b>32,25</b> |
| Regno Unito                   | 5,74         |
| Europa Occidentale - Euro     | 26,52        |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,00         |
| Europa dell'Est               | 0,00         |
| Africa                        | 0,00         |
| Medio Oriente                 | 0,00         |
| <b>Asia</b>                   | <b>7,12</b>  |
| Giappone                      | 0,00         |
| Australasia                   | 2,79         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 4,33         |
| Asia - Emergente              | 0,00         |

Anagrafica

|                        |                                 |                         |              |                              |               |
|------------------------|---------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione    | Lombard Odier Funds (Europe) SA | Patrimonio Classe (Mln) | 36,04 EUR    | Investimento Min. Ingresso   | 1.000.000 EUR |
| Telefono               | 00352 27 78 5000                | (09/02/2026)            |              | Investimento Min. Successivo | 1 CHF         |
| Web                    | www.loim.com                    | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | 0,87%         |
| Data di Partenza       | 11/05/2009                      | Valuta del Fondo        | EUR          | Spese correnti               | 0,88%         |
| Nome del Gestore       | -                               | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -             |
| Data Inizio Gestione   | 05/12/2011                      | Inc/Acc                 | Inc          |                              |               |
| NAV (09/02/2026)       | EUR 22,27                       | ISIN                    | LU0357533461 |                              |               |
| Patrimonio Netto (Mln) | 810,00 EUR                      |                         |              |                              |               |
| (31/12/2025)           |                                 |                         |              |                              |               |