

LO Funds - Euro BBB-BB Fundamental Syst. Hdg (USD) PA

|                               |                                     |   |                            |
|-------------------------------|-------------------------------------|---|----------------------------|
| <b>Categoria Morningstar™</b> | <b>Benchmark Morningstar</b>        | <b>Benchmark Dichiarato</b>               | <b>Morningstar Rating™</b> |
| Obbligazionari Altro          | Not Categorized<br>Usato nel Report | Bloomberg Euro Agg Corps 500MM TR<br>HEUR | Senza rating               |

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

L'obiettivo del Comparto è realizzare reddito regolare e crescita di capitale investendo in obbligazioni e altri titoli di debito a tasso fisso o variabile e a breve termine di emittenti non governativi denominati in EUR a cavallo fra gli universi alta qualità e alto rendimento (ossia con giudizio BBB, BB o equivalente). Il Gestore utilizza un modello proprietario che determina e adegua il peso dell'emittente in base ai suoi fondamentali. L'approccio assicura che i debitori con la maggiore capacità di rimborsare i propri impegni abbiano i pesi maggiori (quanto più alto è il rischio d'inadempienza dell'emittente, tanto più basso è il peso in portafoglio). L'utilizzo di derivati è parte della strategia d'investimento.

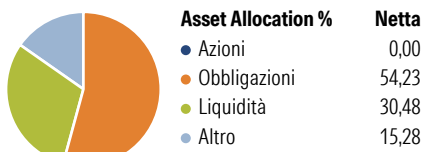
| Misure di Rischio |   |                 |      |
|-------------------|---|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,17 |
| 3Y Beta           | - | 3Y Std Dev      | 7,40 |
| 3Y R-Squared      | - | 3Y Risk         | -    |
| 3Y Info Ratio     | - | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk        | -    |



| Rend. Cumulati % | Fondo | Rendimenti           | Q1    | Q2    | Q3   | Q4    |
|------------------|-------|----------------------|-------|-------|------|-------|
| 3-Mesi           | -1,83 | <b>Trimestrali %</b> |       |       |      |       |
| 6-Mesi           | -0,84 | 2026                 | -     | -     | -    | -     |
| 1-Anno           | -7,20 | 2025                 | -4,38 | -5,79 | 1,75 | 0,64  |
| 3-Anni Ann.ti    | 4,06  | 2024                 | 3,92  | 1,68  | 0,26 | 9,19  |
| 5-Anni Ann.ti    | 2,17  | 2023                 | 0,31  | 0,77  | 3,76 | 2,17  |
| 10-Anni Ann.ti   | 2,50  | 2022                 | -3,26 | -4,85 | 4,50 | -5,31 |

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

**Portafoglio 30/09/2025**



| Fixed Income Style    | Fondo | Credit Quality % | Fond     | Credit Quality % | Fond     |
|-----------------------|-------|------------------|----------|------------------|----------|
| <b>Box™</b>           |       |                  | <b>o</b> |                  | <b>o</b> |
| Duration Effettiva    | -     |                  |          |                  |          |
| Maturity effettiva    | -     | AAA              | 0,00     | BBB              | 54,30    |
| Qualità Credito Media | BB    | AA               | 0,00     | BB               | 26,70    |
|                       |       | A                | 11,80    | B                | 1,50     |
|                       |       |                  |          | Below B          | 0,00     |
|                       |       |                  |          | Not Rated        | 5,70     |

| Titoli principali                           |         |       |
|---|---------|-------|
| Nome  | Settore | %     |
| Euro Bund Future Dec 25                     | —       | 12,57 |
| Euro Schatz Future Dec 25                   | —       | 9,48  |
| Trsbp Cy11 Eu270326p-Trsbp...               | —       | 4,59  |
| Trsbp Cy10 Us270326p-Trsbp...               | —       | 1,96  |
| Euro Bobl Future Dec 25                     | —       | 1,93  |
| Trsct Cy12 Eu270326p-Trsct...               | —       | 1,55  |
| Trsct Cy0y Eu270326p-Trsct...               | —       | 1,51  |
| Euro Buxl Future Dec 25                     | —       | 1,50  |
| Var Energi ASA 7.862%                       | —       | 0,89  |
| Wintershall Dea Finance 2...                | —       | 0,78  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 36,75 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 1.011 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo  |
|----------------------------------|--------|
| Governativo                      | 22,89  |
| Societario                       | 110,81 |
| Cartolarizzazioni                | 0,27   |
| Enti Locali                      | 0,00   |
| Liquidità ed equivalenti         | 36,89  |
| Derivati                         | -70,86 |
| Coupon Range %                   | Fondo  |
| 0 coupon                         | 0,00   |
| Da 0 a 4 cedole                  | 46,62  |
| Da 4 a 6 cedole                  | 35,81  |
| Da 6 a 8 cedole                  | 13,78  |
| Da 8 a 10 cedole                 | 3,73   |
| Da 10 a 12 cedole                | 0,06   |
| Oltre 12 cedole                  | 0,00   |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 9,96  |
| da 3 a 5   | 14,99 |
| da 5 a 7   | 12,58 |
| da 7 a 10  | 12,02 |
| da 10 a 15 | 4,54  |
| da 15 a 20 | 1,61  |
| da 20 a 30 | 2,78  |
| oltre 30   | 16,92 |

**Anagrafica**

|                        |                     |                         |              |                              |           |
|------------------------|---------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione    | Lombard Odier Funds | Patrimonio Classe (Mln) | 4,58 USD     | Investimento Min. Ingresso   | 3.000 EUR |
|                        | (Europe) SA         | (30/01/2026)            |              | Investimento Min. Successivo | -         |
| Telefono               | 00352 27 78 5000    | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | 1,25%     |
| Web                    | www.loim.com        | Valuta del Fondo        | USD          | Spese correnti               | 1,28%     |
| Data di Partenza       | 04/04/2011          | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -         |
| Nome del Gestore       | -                   | Inc/Acc                 | Acc          |                              |           |
| Data Inizio Gestione   | 31/10/2016          | ISIN                    | LU0611911867 |                              |           |
| NAV (30/01/2026)       | USD 24,22           |                         |              |                              |           |
| Patrimonio Netto (Mln) | 469,88 EUR          |                         |              |                              |           |

(30/09/2025)