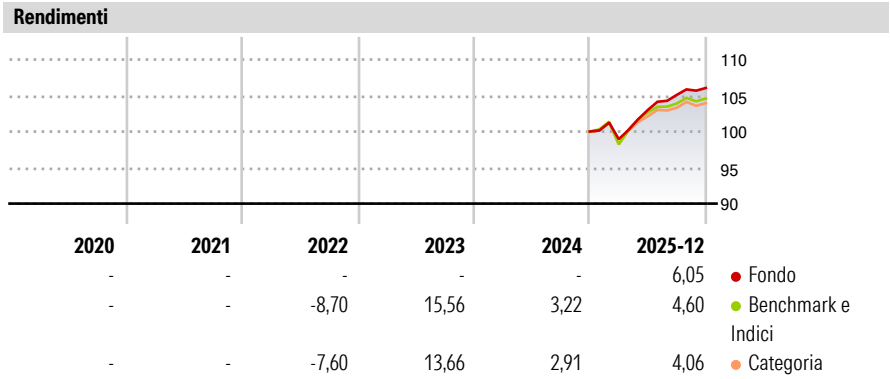


LO Funds - Fallen Angels Recovery Syst. Multi Ccy Hdg, (CHF) SA

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Global High Yield Bond - CHF Hedged	Morningstar Global High-Yield Bond GR Hedged CHF Usato nel Report	Bloomberg Gbl Corp x-EM FA 3% IC TR USD	★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund is actively managed. The Bloomberg Barclays Global Corporate ex-EM Fallen Angels 3% Issuer Capped 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 securities not included in the above-mentioned index in order to take advantage of investment opportunities. In addition to the above-mentioned index, the Bloomberg Barclays Global High Yield...



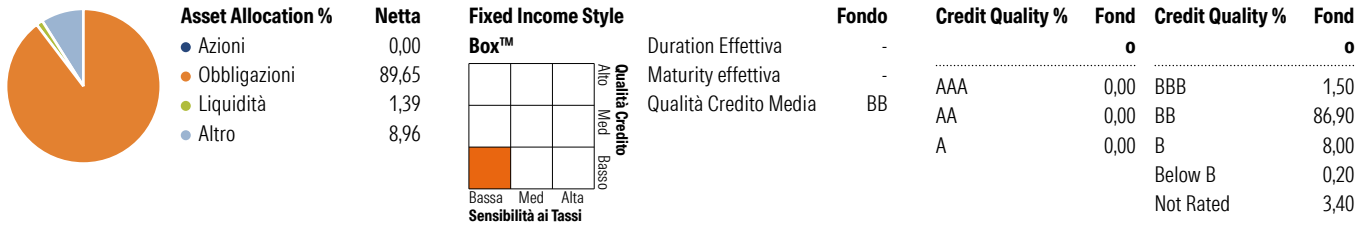
Misure di Rischio			
3Y Alpha	0,35	3Y Sharpe Ratio	0,74
3Y Beta	0,84	3Y Std Dev	5,73
3Y R-Squared	90,80	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,29	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	1,28	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Global High-Yield Bond GR Hedged CHF (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,34	1,67	1,69	2026	-	-	-	-
6-Mesi	3,86	2,95	2,76	2025	-1,06	4,09	2,04	0,91
1-Anno	8,00	6,39	5,86	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	7,44	7,52	6,73	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Portafoglio 30/09/2025



Titoli principali		
Nome	Settore	%
T-Notes 5Yr Future Dec25	—	18,03
Trsbp Cy11 Eu270326p-Trsbp...	—	3,43
Aroundtown Finance S.a.r.l....	—	2,09
Vodafone Group PLC 7%	—	2,07
Dresdner Funding Trust I...	—	1,64
Bayer AG 3.125%	—	1,49
Trsbp Cy10 Us270326p-Trsbp...	—	1,46
Wintershall Dea Finance 2...	—	1,36
Aroundtown Finance S.a.r.l....	—	1,30
ELO SA 4.875%	—	1,24
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		34,11
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		269

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
■ Governativo	-4,19
■ Societario	105,03
■ Cartolarizzazioni	0,05
■ Enti Locali	0,00
■ Liquidità ed equivalenti	0,79
■ Derivati	-1,68
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	25,48
Da 4 a 6 cedole	40,77
Da 6 a 8 cedole	28,70
Da 8 a 10 cedole	5,05
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	14,36
da 3 a 5	20,16
da 5 a 7	10,88
da 7 a 10	6,06
da 10 a 15	5,08
da 15 a 20	4,20
da 20 a 30	3,01
oltre 30	18,40

Anagrafica

Società di Gestione	Lombard Odier Funds (Europe) SA	Patrimonio Classe (Mln)	116,56 CHF	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	00352 27 78 5000	(28/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.loim.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,80%
Data di Partenza	30/11/2021	Valuta del Fondo	CHF	Spese correnti	0,10%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/11/2021	Inc/Acc	Acc		
NAV (28/01/2026)	CHF 10,41	ISIN	LU2346318707		

LO Funds - Fallen Angels Recovery Syst. Multi Ccy Hdg, (CHF) SA

Patrimonio Netto (Mln) 404,48 USD

(30/09/2025)