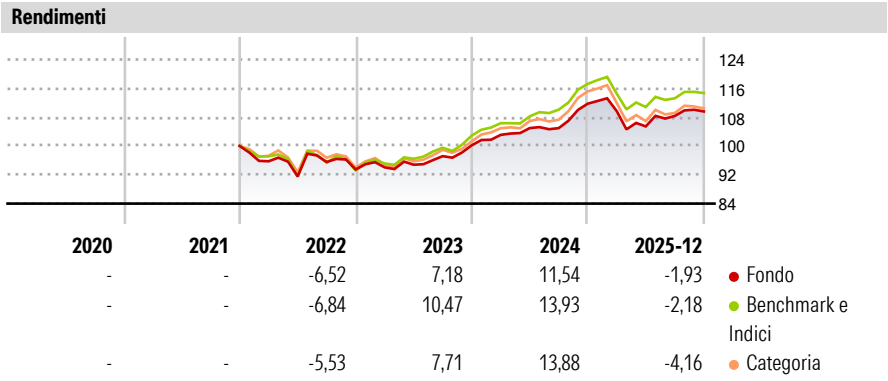


LO Funds - Fallen Angels Recovery (USD) PA

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Globali High Yield	Morningstar Global High-Yield Bond GR USD 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	-0,98	3Y Sharpe Ratio	0,48
3Y Beta	0,87	3Y Std Dev	5,24
3Y R-Squared	94,26	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,36	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	1,32	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,23	1,30	1,23	2026	-	-	-	-
6-Mesi	4,38	4,06	4,11	2025	-1,87	-3,85	2,75	1,16
1-Anno	-1,40	-1,89	-3,97	2024	2,90	1,81	0,01	6,46
3-Anni Ann.ti	5,14	6,60	5,43	2023	0,63	0,78	2,51	3,10
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-4,25	-4,39	4,37	-2,17
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 08/01/2026

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	89,65
Liquidità	1,39
Altro	8,96

Fixed Income Style Box™

Duration Effettiva: -
Maturità effettiva: -
Qualità Credito Media: BB

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Basso, Med, Alta

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	0,00	BBB	1,50
AA	0,00	BB	86,90
A	0,00	B	8,00
		Below B	0,20
		Not Rated	3,40

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)	8,61 USD
Telefono	00352 27 78 5000	Domicilio	LUSSEMBURGO
Web	www.loim.com	Valuta del Fondo	USD
Data di Partenza	30/11/2021	UCITS	Si
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc
Data Inizio Gestione	30/11/2021	ISIN	LU2337256502
NAV (08/01/2026)	USD 11,51	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
		Investimento Min. Successivo	-
		T.E.R.	1,25%
		Spese correnti	1,27%
		Commissione di incentivo	-

LO Funds - Fallen Angels Recovery (USD) PA

Patrimonio Netto (Mln)	404,48 USD
(30/09/2025)	