

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

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Bloomberg Euro Agg Corps 500MM TR

HEUR

Morningstar Rating™

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 | -0,09 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 9,43 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Rendimenti



Rend. Cumulati %

| | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 1,30 |
| 6-Mesi | 1,69 |
| 1-Anno | 3,38 |
| 3-Anni Ann.ti | 1,60 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,06 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,14 |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Rendimenti

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|----------------------|-------|-------|------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | -3,79 | 0,85 | 5,55 | 0,59 |
| 2023 | 0,50 | 1,87 | 0,47 | 9,79 |
| 2022 | -4,56 | -8,96 | 0,65 | -0,48 |
| 2021 | -2,48 | 1,36 | 1,46 | 3,39 |

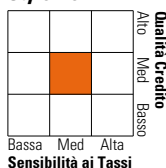
Portafoglio 31/10/2024



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni | 0,00 |
| ● Obbligazioni | 40,93 |
| ● Liquidità | 40,50 |
| ● Altro | 18,57 |

Fixed Income

Style Box™



Sensibilità ai Tassi

| | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Duration Effettiva | - |
| Maturità effettiva | - |
| Qualità Credito Media | BB |

Credit Quality %

| Fond | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % |
|------|------------------|-----------|------------------|
| 0 | 0 | 0 | 0 |
| AAA | 0,00 | BBB | 55,40 |
| AA | 0,00 | BB | 27,60 |
| A | 8,40 | B | 0,20 |
| | | Below B | 0,00 |
| | | Not Rated | 8,40 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Euro Bund Future Dec 24 | - | 13,70 |
| Trsbp Ctkh Eu270325p-Trsbp... | - | 6,78 |
| Euro Schatz Future Dec 24 | - | 5,42 |
| Euro Bobl Future Dec 24 | - | 4,66 |
| Trsbp Ctkc Us270325p-Trsbp... | - | 3,12 |
| Trsct Ctki Eu270325p-Trsct... | - | 2,24 |
| Trsct Ctkj Eu270325p-Trsct... | - | 2,17 |
| Euro Buxl Future Dec 24 | - | 1,45 |
| Trsct Ctkf Us270325p-Trsct... | - | 0,97 |
| Trsct Ctkg Us270325p-Trsct... | - | 0,94 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 41,46 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 964 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|----------------------------|--------|
| 🏛️ Governativo | 19,97 |
| ⚙️ Societario | 95,13 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 0,02 |
| 👤 Enti Locali | 0,00 |
| 📄 Liquidità ed equivalenti | 43,61 |
| 📑 Derivati | -58,72 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 54,72 |
| Da 4 a 6 cedole | 29,04 |
| Da 6 a 8 cedole | 11,27 |
| Da 8 a 10 cedole | 4,96 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,01 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 9,42 |
| da 3 a 5 | 15,00 |
| da 5 a 7 | 10,66 |
| da 7 a 10 | 9,86 |
| da 10 a 15 | 2,35 |
| da 15 a 20 | 1,13 |
| da 20 a 30 | 3,88 |
| oltre 30 | 10,45 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione | Lombard Odier Funds (Europe) SA | Patrimonio Classe (Mln) | 3,99 CHF | Investimento Min. Ingresso | 3.000 EUR |
| Telefono | 00352 27 78 5000 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.loim.com | Valuta del Fondo | CHF | T.E.R. | 1,25% |
| Data di Partenza | 14/02/2011 | UCITS | Si | Spese correnti | 1,27% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 31/10/2016 | ISIN | LU0563304707 | | |
| NAV (03/02/2025) | CHF 15,85 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 506,05 EUR | | | | |

(31/10/2024)