

# LO Funds - Euro BBB-BB Fundamental (EUR) PD Quarterly

## Categoria Morningstar™

Obbligazionari Flessibili EUR

## Benchmark Morningstar

Morningstar Eurozone Core Bond GR EUR

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

Bloomberg Euro Agg Corps 500MM TR

HEUR

## Morningstar Rating™

★★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

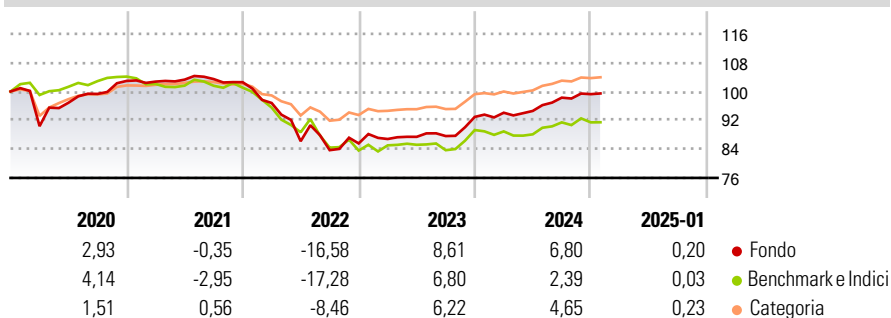
L'obiettivo del Comparto è realizzare reddito regolare e crescita di capitale investendo in obbligazioni e altri titoli di debito a tasso fisso o variabile e a breve termine di emittenti non governativi denominati in EUR a cavallo fra gli universi alta qualità e alto rendimento (ossia con giudizio BBB, 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	2,23	3Y Sharpe Ratio	-0,32
3Y Beta	0,94	3Y Std Dev	7,94
3Y R-Squared	75,20	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,63	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	3,87	10Y Risk	+Med

Basati su Morningstar Eurozone Core Bond GR EUR (dove applicabile)

### Rendimenti



### Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,61	1,18	1,41
6-Mesi	3,33	1,58	2,69
1-Anno	6,82	3,80	5,42
3-Anni Ann.ti	-0,19	-2,22	1,56
5-Anni Ann.ti	-0,26	-2,04	0,89
10-Anni Ann.ti	0,87	0,09	0,95

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

### Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	1,25	0,53	3,91	0,98
2023	1,45	0,69	0,25	6,06
2022	-5,63	-10,97	-2,87	2,22
2021	-0,18	0,53	0,15	-0,84

### Portafoglio 31/10/2024



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

### Fixed Income

#### Style Box™

		Qualità Credito		
		Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Alto			
	Med			
	Basso			

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	BB

### Credit Quality %

	Fond	Credit Quality %	Fond
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
Gov	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)	0,91 EUR	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	00352 27 78 5000	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.loim.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,25%
Data di Partenza	31/01/2013	UCITS	Si	Spese correnti	1,28%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	31/10/2016	ISIN	LU0878857985		
NAV (03/02/2025)	EUR 11,02				
Patrimonio Netto (Mln)	506,05 EUR				

(31/10/2024)