

LO Funds - Euro BBB-BB Fundamental (EUR) MA

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

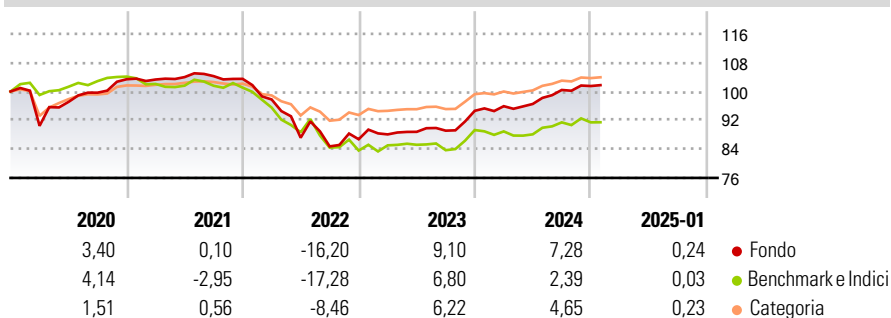
L'obiettivo del Comparto è realizzare reddito regolare e crescita di capitale investendo in obbligazioni e altri titoli di debito a tasso fisso o variabile e a breve termine di emittenti non governativi denominati in EUR a cavallo fra gli universi alta qualità e alto rendimento (ossia con giudizio BBB, 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 | 2,68 | 3Y Sharpe Ratio | -0,26 |
| 3Y Beta | 0,94 | 3Y Std Dev | 7,94 |
| 3Y R-Squared | 75,20 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | 0,75 | 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 | 1,69 | 1,18 | 1,41 |
| 6-Mesi | 3,59 | 1,58 | 2,69 |
| 1-Anno | 7,33 | 3,80 | 5,42 |
| 3-Anni Ann.ti | 0,56 | -2,22 | 1,56 |
| 5-Anni Ann.ti | 0,20 | -2,04 | 0,89 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,33 | 0,09 | 0,95 |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|--------|-------|-------|
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | 1,36 | 0,64 | 4,03 | 1,09 |
| 2023 | 1,56 | 0,81 | 0,36 | 6,18 |
| 2022 | -5,52 | -10,87 | -2,76 | 2,33 |
| 2021 | -0,07 | 0,64 | 0,26 | -0,73 |

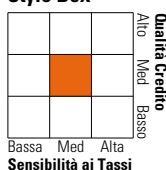
Portafoglio 31/10/2024



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

Fixed Income

Style Box™



| | 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 |
|--------------------------|--------|
| 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) | 74,78 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. | 0,80% |
| Data di Partenza | 07/02/2013 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,82% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 31/10/2016 | ISIN | LU0866419335 | | |
| NAV (04/02/2025) | EUR 14,46 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 506,05 EUR | | | | |

(31/10/2024)