

LO Funds - Euro BBB-BB Fundamental Syst. Hdg (USD) MA

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	0,30
3Y Beta	-	3Y Std Dev	8,64
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	7,17
6-Mesi	9,89
1-Anno	13,47
3-Anni Ann.ti	6,04
5-Anni Ann.ti	3,10
10-Anni Ann.ti	4,07

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	4,04	1,79	0,38	9,32
2023	0,43	0,88	3,87	2,28
2022	-3,15	-4,74	4,62	-5,20
2021	4,23	-0,08	2,77	1,41

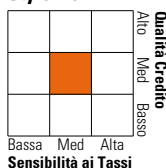
Portafoglio 31/10/2024



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
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)	5,86 USD	Investimento Min. Ingresso	3.000 EUR
Telefono	00352 27 78 5000	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.loim.com	Valuta del Fondo	USD	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	LU0866419764		
NAV (04/02/2025)	USD 24,32				
Patrimonio Netto (Mln)	506,05 EUR				

(31/10/2024)