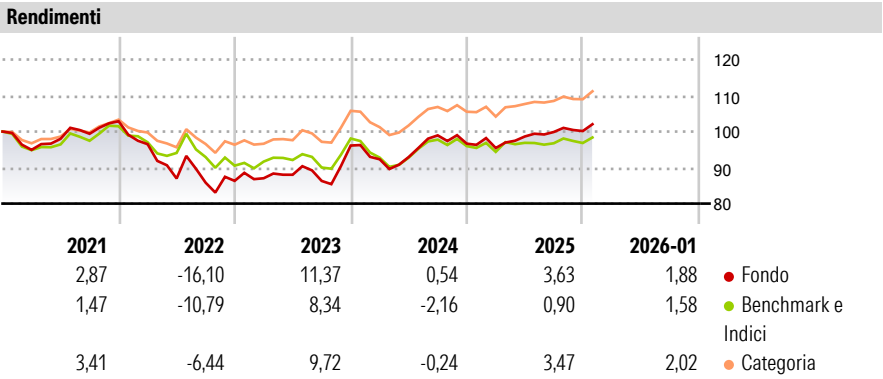


LO Funds - Global BBB-BB Fundamental Syst. Hdg (CHF) MA

| | | | |
|-------------------------------|--|--|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Global Flexible - CHF Covered | Morningstar Global Core Bond GR Hedged CHF Usato nel Report | Bloomberg Gbl Agg 500 MM Corp TR Hdg EUR | ★★ |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

L'obiettivo del Comparto è generare un rendimento regolare e una crescita del capitale. Investe principalmente in obbligazioni, altri titoli di debito a tasso fisso o variabile e titoli di debito a breve termine di emittenti non governativi denominati in varie monete (tra cui USD, EUR, GBP e JPY) con merito di credito a cavallo tra la fascia medio-alta ("investment grade") e quella di qualità inferiore ("high yield", con rating BBB, BB o equivalente). Il Gestore utilizza applica una metodologia proprietaria che determina e modifica la ponderazione di ogni emittente in base ai suoi fattori economici fondamentali. Questo approccio è studiato affinché le principali ponderazioni vengano attribuite ai prestatori con la maggiore capacità di...



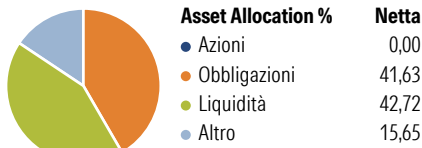
| Misure di Rischio | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 2,46 | 3Y Sharpe Ratio | 0,27 |
| 3Y Beta | 1,15 | 3Y Std Dev | 7,68 |
| 3Y R-Squared | 81,61 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | 0,97 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 2,34 | 10Y Risk | +Med |

Basati su Morningstar Global Core Bond GR Hedged CHF (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 2,60 | 0,78 | 1,79 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 4,51 | 2,94 | 4,15 | 2025 | -1,25 | 3,35 | 1,26 | 0,27 |
| 1-Anno | 5,76 | 3,31 | 6,29 | 2024 | -3,98 | 0,69 | 6,46 | -2,32 |
| 3-Anni Ann.ti | 4,92 | 2,51 | 3,97 | 2023 | 0,84 | 1,12 | -1,95 | 11,39 |
| 5-Anni Ann.ti | 0,62 | -0,10 | 1,66 | 2022 | -6,20 | -9,87 | -1,33 | 0,58 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,37 | 0,79 | 2,51 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 10/02/2026

Portafoglio 30/09/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|-------------------------|-------|------------------|-------|------------------|-------|
| Duration Effettiva | - | AAA | 0,00 | BBB | 52,80 |
| Maturità effettiva | - | AA | 0,00 | BB | 32,90 |
| Qualità Credito Media | BB | A | 10,00 | B | 1,60 |
| | | | | Below B | 0,10 |
| | | | | Not Rated | 2,60 |

| Titoli principali | | |
|---|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| 10 Year Treasury Note Future... | — | 23,44 |
| Ultra US Treasury Bond... | — | 7,14 |
| Trsbp Cy11 Eu270326p-Trsbp... | — | 4,94 |
| Euro Bund Future Dec 25 | — | 3,74 |
| T-Notes 2Yr Future Dec25 | — | 2,35 |
| Trsbp Cy10 Us270326p-Trsbp... | — | 2,10 |
| Trsct Cy12 Eu270326p-Trsct... | — | 1,67 |
| Trsct Cy0y Eu270326p-Trsct... | — | 1,63 |
| Euro Schatz Future Dec 25 | — | 1,25 |
| Wintershall Dea Finance 2... | — | 0,86 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 49,14 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 1.097 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo | Scadenze % | Fondo |
|----------------------------------|--------|------------|-------|
| Governativo | 5,67 | da 1 a 3 | 7,59 |
| Societario | 115,35 | da 3 a 5 | 12,50 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 | da 5 a 7 | 10,80 |
| Enti Locali | 0,00 | da 7 a 10 | 11,49 |
| Liquidità ed equivalenti | 52,17 | da 10 a 15 | 5,24 |
| Derivati | -73,18 | da 15 a 20 | 2,50 |
| | | da 20 a 30 | 6,00 |
| | | oltre 30 | 13,20 |
| Coupon Range % | Fondo | | |
| 0 coupon | 0,00 | | |
| Da 0 a 4 cedole | 27,37 | | |
| Da 4 a 6 cedole | 42,87 | | |
| Da 6 a 8 cedole | 22,68 | | |
| Da 8 a 10 cedole | 6,47 | | |
| Da 10 a 12 cedole | 0,61 | | |
| Oltre 12 cedole | 0,00 | | |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione | Lombard Odier Funds (Europe) SA | Patrimonio Classe (Mln) | 1,68 CHF | Investimento Min. Ingresso | 3.000 EUR |
| Telefono | 00352 27 78 5000 | (10/02/2026) | | Investimento Min. Successivo | 1 EUR |
| Web | www.loim.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,97% |
| Data di Partenza | 27/06/2013 | Valuta del Fondo | CHF | Spese correnti | 1,03% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 31/10/2016 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (10/02/2026) | CHF 11,44 | ISIN | LU0866422040 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 268,03 USD | | | | |

(30/09/2025)