

BASISINFORMATIONSBLATT

Zweck

Dieses Informationsblatt stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und Ihnen dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

Produkt

LO Funds - DOM Global Macro, (USD), NA

Name des PRIIP-Anbieters: Lombard Odier Funds (Europe) S.A. gehört zur Lombard Odier Gruppe.

ISIN: LU2886208227

Website für PRIIP-Anbieter: www.loim.com

Rufen Sie uns an unter +41 22 709 9333 oder schreiben Sie eine E-Mail an loim-client-servicing@lombardodier.com, um nähere Informationen zu erhalten.

Die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) ist für die Beaufsichtigung von Lombard Odier Funds (Europe) S.A. in Bezug auf dieses Basisinformationsblatt (KID) verantwortlich. Lombard Odier Funds (Europe) S.A. ist in Luxemburg zugelassen und wird von der CSSF reguliert.

Lombard Odier Funds (Europe) S.A. fungiert als Verwaltungsgesellschaft gemäss Kapitel 15 des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen.

Dieses PRIIP ist in Luxemburg zugelassen.

Datum der Überarbeitung und Erstellung: 28 Januar 2025.

Sie sind im Begriff, ein Produkt zu kaufen, das komplex und möglicherweise schwer zu verstehen ist.

Um welche Art von Produkt handelt es sich?

Art

Der Teilfonds ist Teil des Fonds LO Funds, einer Aktiengesellschaft (société anonyme), die nach den Gesetzen des Grossherzogtums Luxemburg als Investmentgesellschaft mit variablem Grundkapital gegründet wurde. Der Fonds unterliegt Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“).

Laufzeit

Der Teilfonds hat kein Fälligkeitsdatum. Der PRIIP-Anbieter ist berechtigt, den Teilfonds unter den in den Gründungsunterlagen des Fonds vorgesehenen Umständen einseitig zu kündigen. Eine Liquidation des Fonds führt zur automatischen Schliessung des Teilfonds.

Ziele

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet. Die Verwaltung des Teilfonds orientiert sich nicht an einer Benchmark.

"DOM" steht für "Diversified-Orthogonal-Multi-Strategie".

Ziel des Teilfonds ist es, durch die Umsetzung einer Global-Macro-Strategie Renditen zu erzielen. Mit dieser Strategie soll eine diversifizierte Palette (Multi-Strategie) orthogonaler (unkorrelierter) Renditequellen erschlossen werden.

Um dieses Ziel zu erreichen, baut der Fondsmanager ein diversifiziertes Portefeuille auf, in dem er regelbasierte Strategien und diskretionäre Engagements kombiniert, die in verschiedenen Marktregimes positive Renditen erzielen sollen.

Zu den eingesetzten Strategien gehören unter anderem: (i) regelbasierte quantitative Strategien, die durch ein Engagement in spezifischen Risikoprämien sowie durch Relative-Value-Chancen in bestimmten Anlageklassen alternative Renditequellen erschliessen sollen; (ii) Makro-Strategien, die an makroökonomischen Trends partizipieren und Fehlbewertungen ausnutzen sollen, die aus der Divergenz zwischen den ökonomischen Fundamentaldaten und politischen/geldpolitischen Massnahmen entstehen und damit asymmetrische Risiko-Rendite-Chancen hervorbringen; (iii) Strategien, die beim Kauf und Verkauf von Optionen einen wertorientierten Ansatz verfolgen; (iv) konvexe (d.h. defensive) Strategien mit einem asymmetrischen Auszahlungsprofil, die das Portefeuille vor Extremrisiken schützen sollen; und (v) Strategien, die die vorgenannten Ansätze beliebig miteinander kombinieren.

In das Anlageverfahren sind drei Arten der Allokation eingebettet: (i) eine strategische Allokation, die über einen gesamten Marktzyklus hinweg ein diversifiziertes Portefeuille ergibt, (ii) eine dynamische Allokation, die ein dem aktuellen Markt- und Makroumfeld angepasstes Portefeuille ergibt, (iii) eine opportunistische Allokation mit dem Ziel, einzigartige Anlagechancen zu nutzen.

Der Teilfonds kann in eine breite Palette von Finanzderivaten und OTC-Derivaten investieren, um Long- und Short-Positionen in jeglichen Anlageklassen, Währungen (von OECD-Staaten und/oder Emerging Markets), Märkten (einschliesslich Emerging Markets) und/oder Indizes (einschliesslich Rohstoffindizes) einzugehen.

Dieses Teilvermögen ist möglicherweise nicht für Anleger geeignet, die ihr Geld innerhalb von 5 Jahren entnehmen möchten.

Nachhaltigkeit

Dieses Finanzprodukt ist kein Finanzprodukt im Sinne von Artikel 8 oder Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (die „SFDR“). Die Anlagen, die diesem Finanzprodukt zugrunde liegen, berücksichtigen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht.

Kleinanleger-Zielgruppe

Der Teilfonds eignet sich nur für (i) institutionelle Anleger oder Privatanleger, die als "finanziell erfahrene Anleger" eingestuft sind, (ii) einen langfristigen Anlagehorizont haben und (iii) über ausreichende Mittel verfügen, um etwaige Verluste (unter Umständen bis zur Höhe des gesamten Anlagebetrages), die sich möglicherweise aus einer Anlage in dem Teilfonds ergeben, verkraften zu können. Ein "finanziell erfahrener Anleger" ist ein Anleger, der (i) Kenntnisse und Anlageerfahrung in Bezug auf die Finanzmärkte allgemein sowie in Bezug auf Finanzprodukte, die in Wertpapiere und/oder Derivate mit komplexen Eigenschaften investieren, hat und (ii) die Strategie, die Merkmale und die Risiken des Teilfonds versteht und beurteilen kann, um eine fundierte Anlageentscheidung treffen zu können.

Zusätzliche Informationen

Informationen über die SICAV, ihre Teilfonds und die verfügbaren Anteilklassen finden Sie online unter www.loim.com. Dort finden Sie auch Informationen darüber, wie Sie Anteile kaufen oder verkaufen oder zwischen den verschiedenen Teilfonds der SICAV wechseln können. Der Prospekt sowie die Jahres- und Halbjahresberichte für die SICAV und die Einzelheiten zur aktuellen Vergütungspolitik von Lombard Odier Funds (Europe) S.A. sind über die Website www.loim.com und am eingetragenen Sitz der SICAV in der route d'Arlon 291 in L-1150 Luxemburg kostenlos erhältlich.

Der Nettoinventarwert pro Anteil wird täglich berechnet und ist unter www.loim.com und am eingetragenen Sitz der SICAV verfügbar.

Der Wert der zugrunde liegenden Anteile des Teilfonds wird bestimmt durch den Wert der Wertpapiere, in die das Teilfonds direkt investiert ist.

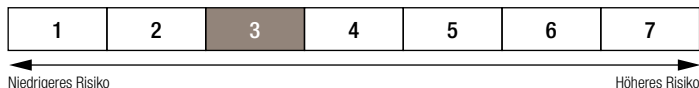
Ausschüttungspolitik: Erträge Thesaurierung.

Handelsfrequenz: Sie können Anteile dieses Teilfonds auf Wunsch auf täglich Basis zurückgeben.

Die Verwahrstelle ist CACEIS Bank, Luxembourg Branch.

Welche Risiken bestehen und was könnte ich im Gegenzug dafür bekommen?

RISIKOPROFIL



Der synthetischer Risikoindikator setzt voraus, dass Sie das Produkt für 5 Jahre behalten.

Der synthetischer Risikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt

verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen.

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.

Wenn wir Ihnen nicht das zahlen können, was Ihnen zusteht, könnten Sie das gesamte angelegte Kapital verlieren.

Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 3 eingestuft, wobei 3 einer mittelniedrigen Risikoklasse entspricht.

Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelniedrig eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich, dass unsere Fähigkeit beeinträchtigt wird, Sie auszuzahlen.

Die nachfolgend aufgeführten Risiken können wesentliche Auswirkungen haben, sind aber nicht immer angemessen im synthetischen Risikoindikator abgebildet und können deshalb zusätzliche Verluste verursachen: Gegenparteirisiko, Risiken aus dem Einsatz von Derivaten und Finanztechniken, Modellrisiko und Operative Komplexität.

PERFORMANCE-SZENARIEN

Die angegebenen Zahlen beinhalten alle Kosten für das Produkt selbst. Die Zahlen berücksichtigen nicht Ihre persönliche Steuersituation, die sich ebenfalls auf die Höhe Ihrer Rückzahlung auswirken kann. Wie viel Sie aus diesem Produkt erhalten werden, hängt von der zukünftigen Marktentwicklung ab. Zukünftige Marktentwicklungen sind ungewiss und können nicht genau vorhergesagt werden. Die Märkte können sich in der Zukunft völlig anders entwickeln als erwartet. Die dargestellten pessimistische, mittlere und optimistische Szenarien sind Illustrationen auf Basis der schlechtesten, durchschnittlichen und besten Performance einer geeigneten Benchmark über die letzten 10 Jahre. Derartige Szenarien traten bei einer Investition zwischen 31.12.2014 und 31.12.2024 ein. Das Stressszenario gibt an, was Sie unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen könnten.

Empfohlene Mindesthaltedauer: 5 Jahre

Anlagenbeispiel USD 1'000'000

| Szenarien | | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen | Wenn Sie nach 5 Jahren (empfohlene Mindesthaltedauer) aussteigen |
|---------------------------------|--|---------------------------------|--|
| Minimum | Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Sie könnten Ihre Investition ganz oder teilweise verlieren. | | |
| Stressszenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | USD 637'790 | USD 575'480 |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -36.22% | -10.46% |
| Pessimistisches Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | USD 888'790 | USD 938'600 |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -11.12% | -1.26% |
| Mittleres Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | USD 1'070'530 | USD 1'442'590 |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | 7.05% | 7.60% |
| Optimistisches Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | USD 1'262'590 | USD 1'820'600 |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | 26.26% | 12.73% |

Was geschieht, wenn Lombard Odier Funds (Europe) S.A. nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Die Insolvenz des Herstellers würde die Auszahlungsfähigkeit des Fonds nicht beeinträchtigen. Sie könnten jedoch einen finanziellen Verlust erleiden, wenn die Verwahrstelle ihren Verpflichtungen nicht nachkommt. Dieses Ausfallrisiko ist begrenzt, da die Verwahrstelle gesetzlich und regulatorisch verpflichtet ist, ihre eigenen Vermögenswerte von denen des Fonds zu trennen. Es gibt keine Entschädigungs- oder Garantieregelung, die diese potenziellen Verluste vollständig oder teilweise ausgleichen könnte.

Welche Kosten entstehen?

Die Person, die Sie über dieses Produkt berät oder Ihnen dieses Produkt verkauft, kann Ihnen weitere Kosten in Rechnung stellen. In diesem Fall wird diese Person Sie über diese Kosten und deren Auswirkungen auf Ihre Anlage aufklären.

KOSTEN IM ZEITVERLAUF

Die Tabellen zeigen die Beträge, die von Ihrer Anlage zur Deckung verschiedener Kostenarten abgezogen werden. Die Höhe dieser Beträge hängt davon ab, wie viel Sie investieren, wie lange Sie das Produkt halten und wie gut es sich entwickelt. Bei den hier aufgeführten Beträgen handelt es sich lediglich um Beispiele, die auf einem fiktiven Anlagebetrag und verschiedenen möglichen Anlagezeiträumen basieren.

Wir haben Folgendes angenommen:

- Das Produkt entwickelt sich gemäss dem mittleren Szenario
- USD 1'000'000 wird investiert

| USD 1'000'000 werden angelegt | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen | Wenn Sie nach 5 Jahren (empfohlene Mindesthaltedauer) aussteigen |
|---|---------------------------------|--|
| Kosten insgesamt | USD 19'300 | USD 112'335 |
| Jährliche Auswirkungen der Kosten* | 1.93% | 1.93% |

(*) Dies veranschaulicht, wie die Kosten Ihre Rendite jedes Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie zum Beispiel nach der empfohlenen Mindesthaltedauer aussteigen, wird Ihre durchschnittliche jährliche Rendite auf 9.53% vor Kosten und 7.60% nach Kosten geschätzt. Ein Teil der Kosten kann an den Vertrieber für seine Dienstleistungen gezahlt werden, der das Produkt vertreibt. Dieser legt den Betrag offen.

Die nachstehende Tabelle gibt Aufschluss über die alljährliche Auswirkung der verschiedenen Kostenarten auf die Anlagerendite, die Sie am Ende der empfohlenen Mindesthaltedauer erzielen könnten, und über die verschiedenen Kostenkategorien.

ZUSAMMENSETZUNG DER KOSTEN

| Einmalige Kosten beim Ein- oder Ausstieg | | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen |
|--|---|---------------------------------|
| Einstiegskosten | Wir berechnen keine Einstiegsgebühr. | USD 0 |
| Ausstiegskosten | Wir berechnen keine Ausstiegsgebühr für dieses Produkt, die Person, die Ihnen das Produkt verkauft, kann jedoch eine Gebühr berechnen. | USD 0 |
| Jährlich anfallende laufende Kosten | | |
| Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten | 1.85% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Dies ist eine Schätzung aller Verwaltungs- und Betriebskosten (mit Ausnahme der Transaktionskosten). | USD 18'500 |
| Transaktionskosten | 0.08% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung der Kosten, die anfallen, wenn wir die zugrunde liegenden Anlagen für das Produkt kaufen oder verkaufen. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie viel wir kaufen und verkaufen. In Verbindung mit der Anlage in zugrunde liegende Fonds können auch zusätzliche Gebühren anfallen. | USD 800 |
| Nebenkosten | | |
| Erfolgsgebühren | 15% - no hurdle rate. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie gut sich Ihre Anlage entwickelt. Die vorstehende Schätzung der kumulierten Kosten enthält den Durchschnitt der letzten fünf Jahre. | USD 0 |

Wie lange sollte ich die Anlage halten und kann ich vorzeitig Geld entnehmen?

Empfohlene Mindesthaltedauer: 5 Jahre

Das ist der Zeitraum, den wir Ihnen angesichts des Risikos und der erwarteten Rendite des Produkts als Haltedauer Ihrer Anlage empfehlen.

Einzelheiten zur Handelsfrequenz sind im Abschnitt "Um welche Art von Produkt handelt es sich?" zu finden. Sie können Ihre Anlage gemäss den Prospektregeln des Fonds zurückgeben.

Bitte beachten Sie, dass die erwartete Rendite nicht garantiert ist.

Wie kann ich mich beschweren?

Wenn Sie sich über das Produkt oder über das Verhalten des Anbieters oder der Person, die über das Produkt berät oder das Produkt verkauft, beschweren möchten, können Sie das auf drei Arten tun:

- Sie können bei unserer Beschwerde-Hotline unter +352 27 78 1000 anrufen, wo Ihre Beschwerde aufgenommen und Ihnen erklärt wird, was zu tun ist.
- Sie können Ihre Beschwerde per E-Mail an luxembourg-funds@lombardodier.com senden.
- Sie können Ihre Beschwerde schriftlich an Complaints Department, Lombard Odier Funds (Europe) S.A. 291, route d'Arlon, L-1150 Luxemburg, senden.

Sonstige zweckdienliche Angaben

Der aktuelle Prospekt, Jahres- und Halbjahresberichte, aktualisierte PRIIP KID und andere Produktinformationen sind online unter www.loim.com verfügbar. Es liegen nicht genügend Daten vor, um eine sinnvolle Aussage über die frühere Wertentwicklung zu treffen.

Spezifische Informationen für Schweizer Anleger:

Vertretung in der Schweiz: Lombard Odier Asset Management (Switzerland) SA; 6, avenue des Morgines; 1213 Petit-Lancy.

Zahlstelle in der Schweiz: Bank Lombard Odier & Co Ltd; 11, rue de la Corraterie; 1204 Genève.

Die oben genannten Dokumente sind kostenlos erhältlich bei der Vertretung in der Schweiz.