

WESENTLICHE ANLEGERINFORMATIONEN

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Fonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Fonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, sodass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

LO Funds - Convertible Bond Asia, Syst. NAV Hdg, (EUR), MA

Ein Teilfonds (der "Teilfonds") der Lombard Odier Funds (die "SICAV")

Kategorie M, Klasse thesaurierend, EUR, gehedged, ISIN LU0866415184 (die "Klasse")

Die SICAV wird von Lombard Odier Funds (Europe) S.A. verwaltet, die zur Lombard Odier Group gehört.

Ziele und Anlagepolitik

Ziele und Anlagepolitik

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet. Der Thomson Reuters Convertible Asia Ex-Japan TR Index wird für Performancevergleiche und zur internen Risikoüberwachung herangezogen, ohne dass dies besondere Anlagebeschränkungen für den Teilfonds zur Folge hätte. Die Wertpapiere, die der Teilfonds erwerben möchte, können jenen des Index in einem Umfang ähnlich sein, der im Zeitverlauf variiert. Doch in Bezug auf ihre Gewichtung dürften sich deutliche Unterschiede ergeben. Die Performance des Teilfonds kann wesentlich von der des Index abweichen. Dieser Teilfonds strebt langfristiges Kapitalwachstum an. Er investiert hauptsächlich in Anleihen, die in Aktien asiatischer Unternehmen wandelbar sind und auf verschiedene Währungen lauten, sowie in synthetische Wandelanleihen (getrennter Kauf von Anleihen und Optionen). Der Teilfonds nutzt die asymmetrische Struktur von Wandelanleihen. So profitiert er gleichzeitig von höheren Aktienkursen und vom Schutz festverzinslicher Anlagen vor Kursverlusten. Ausgewogene Wandelanleihen von asiatischen Unternehmen sind die Hauptanlagen. Sie reagieren auf Aktienkurse, schützen bei einem Konjunkturabschwung aber konsequent vor Kursverlusten und sind daher attraktiv. Der Fondsmanager berücksichtigt bei der Zusammenstellung der Titel anlagentechnische Kriterien ebenso wie die Aktie hinter der jeweiligen Wandelanleihe. Im Rahmen der Anlagestrategie werden auch Derivate eingesetzt. Der Teilfonds ist ein

Produkt, das ökologische oder soziale Merkmale oder eine Kombination dieser Merkmale im Sinne von Artikel 8 der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor bewirbt. Der Fondsmanager analysiert das Nachhaltigkeitsprofil der Anlagen des Teilfonds nach einem mehrdimensionalen Ansatz (einschliesslich nachhaltigkeitsbezogener Screenings und Scorings, Ausschlüsse, Beschränkungen sowie qualitativer und quantitativer Überprüfungen).

Informationen

- Anlagehorizont: Dieser Teilfonds ist unter Umständen ungeeignet für Anleger, die ihr Geld innerhalb von 5 Jahren aus dem Fonds abziehen wollen.
- Handelbarkeit: Die Anteile dieses Teilfonds können auf Anfrage täglich verkauft werden.
- Referenzwährung des Teilfonds ist der USD. Die Währung dieser Klasse lautet auf EUR. Das Währungsrisiko wird gehedged. Das Währungsrisiko zwischen der Basiswährung des Teilfonds und der Referenzwährung der Anteilsklasse wird abgesichert. Die Absicherung kann möglicherweise das Währungsrisiko der Positionen auf Portfolioebene nicht vollständig beseitigen, und die Wertentwicklung könnte beeinträchtigt werden.
- Ergebnisverwendung: thesaurierend.

Risiko- und Ertragsprofil

| | | | | | | |
|------------------------|---|---|--------------------|---|---|---|
| Geringeres Risiko | | | Höheres Risiko | | | |
| ← Niedrigeren Erträgen | | | → Höheren Erträgen | | | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |

Was bedeutet dies?

Der SRRI repräsentiert die jährliche Schwankungsbreite des Teilfonds in den letzten 5 Jahren. Wenn für 5 Jahre nicht genug Daten verfügbar sind, werden die fehlenden Renditen anhand einer angemessenen Benchmark simuliert. Der SRRI kann sich verändern und sollte nicht als Indikator für die zukünftigen Risiken oder Renditen herangezogen werden. Auch die niedrigste Risikokategorie bedeutet nicht, dass der Teilfonds risikofrei oder das Kapital geschützt ist.

Kategorie

Dieser Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in Wandelanleihen von asiatischen Unternehmen aus allen Branchen. Investiert wird hauptsächlich in ausgewogene Wandelanleihen mit hoher Kreditwürdigkeit. Diese funktionieren wie Aktienanlagen, bieten dank ihres Anleiheelements aber Schutz vor Kursverlusten. Der Teilfonds geht über seine Nicht-USD-Anlagen auch Positionen in Währungen ein.

Birgt der Teilfonds weitere besondere Risiken?

Die nachfolgend aufgeführten Risiken können wesentliche Auswirkungen

haben, sind aber nicht immer angemessen im synthetischen Risikoindikator abgebildet und können deshalb zusätzliche Verluste verursachen:

- Kreditrisiko: Wenn ein erheblicher Anteil des Vermögens in Schuldpapiere oder riskante Wertpapiere angelegt wird, kann das Ausfallrisiko oder ein tatsächlich eingetretener Ausfall grosse Auswirkungen auf die Wertentwicklung haben. Die Wahrscheinlichkeit, dass dies eintritt, hängt von der Kreditwürdigkeit der Emittenten ab.
- Liquiditätsrisiko: Wenn ein erheblicher Vermögensanteil in Finanzinstrumente angelegt wird, deren Handelbarkeit unter bestimmten Umständen relativ gering ist, besteht ein materielles Risiko, dass der Fonds nicht zu günstigen Zeiten oder Preisen handeln kann. Das kann die Renditen des Fonds schmälern.
- Operatives Risiko und Risiken im Zusammenhang mit der Wertpapieraufbewahrung: Unter bestimmten Umständen besteht ein materielles Verlustrisiko, das aus menschlichen Irrtümern, unzureichenden oder fehlerhaften internen Systemen, Prozessen oder Kontrollen oder aus externen Ereignissen resultiert.

Nähere Informationen zu den Risiken sind in Anhang B "Risikofaktoren" des Fondsprospekts enthalten.

Kosten

Einmalige Kosten vor und nach der Anlage

| | |
|---------------------------|--------------|
| Ausgabeaufschläge | Bis zu 5.00% |
| Rücknahmeabschläge | 0.00% |

Dabei handelt es sich um den Höchstbetrag, der von Ihrer Anlage vor der Anlage/vor der Auszahlung Ihrer Rendite abgezogen wird.

Kosten, die von der Klasse im Laufe des Jahrs abgezogen werden

| | |
|------------------------|-------|
| Laufende Kosten | 1.18% |
|------------------------|-------|

Kosten, welche die Klasse unter bestimmten Umständen zu tragen hat

| | |
|---|-------|
| An die Wertentwicklung des Fonds gebunden Kosten | Keine |
|---|-------|

Die von Ihnen getragenen Kosten gewährleisten die Verwaltung des Teilfonds sowie dessen Vertrieb und Vermarktung. Diese Kosten beeinträchtigen die Wertentwicklung des Fonds. Bei den

Ausgabeaufschlägen und Rücknahmeabschlägen handelt es sich um Maximalangaben. Der Umtausch von Anteilen in Anteile eines anderen Teilfonds ist gebührenpflichtig. Die Gebühr beträgt höchstens 0.50% des Werts der umgetauschten Anteile.

Die Einstiegs- und Ausstiegsgebühren können um eine Handelsabgabe von maximal 3.00% zugunsten des Teilfonds erhöht werden, um die Auswirkungen der Portfolio Transaktionskosten zu reduzieren. Unter Umständen wird Ihnen weniger belastet. Ihr Berater oder Ihre Vertriebsstelle kann Ihnen weitere Informationen geben. Die laufenden Kosten werden für die 12-Monats-Periode berechnet, die mit Datum dieses Dokuments endet. Die Höhe dieser Kosten kann sich jährlich verändern. Weitere Informationen zu den Kosten können Abschnitt 10, "Kosten und Aufwendungen", des Fondsprospekts entnommen werden. Dieser ist über die Webseite www.loim.com abrufbar.

Wertentwicklung in der Vergangenheit

Hinweis zur Wertentwicklung

Die historische Wertentwicklung ist kein zuverlässiger Indikator für die laufende oder zukünftige Wertentwicklung. Die Wertentwicklung im Diagramm zeigt die Renditen der Anlageklasse. Diese Renditen stellen die Veränderung des Nettoinventarwerts des Teilfonds in 1 Jahr dar (in % und der Referenzwährung des Anteils).

Kosten und Gebühren

Die Gebühren für die laufenden Kosten des Teilfonds sind in der

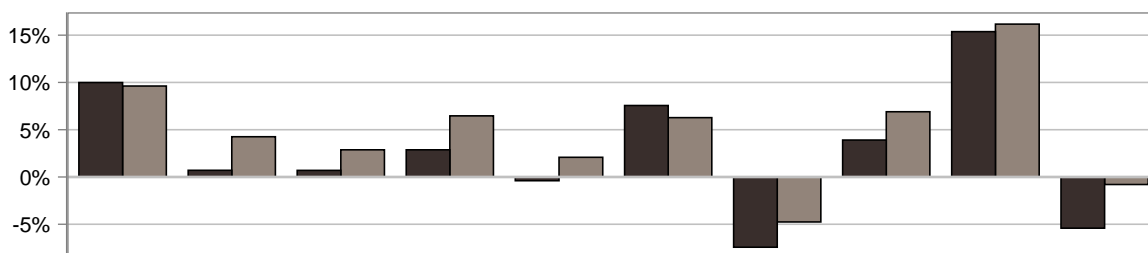
Berechnung der historischen Wertentwicklung enthalten. Ausgabe- und Rücknahmegebühren sind in der Berechnung der historischen Wertentwicklung nicht enthalten.

Lancierungsdatum und Währung

Lancierungsdatum des Teilfonds: 15. Dezember 2008.

Basiswährung des Teilfonds: USD.

Die frühere Wertentwicklung wurde in EUR berechnet.



| | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 |
|--|-------|------|------|------|-------|------|-------|------|-------|-------|
| ■ LO Funds - Convertible Bond Asia, Syst. NAV Hdg, (EUR), MA | 10.0% | 0.7% | 0.7% | 2.9% | -0.4% | 7.6% | -7.4% | 3.9% | 15.4% | -5.4% |
| ■ Refinitiv Convertible Asia Ex-Japan EUR Hedged | 9.6% | 4.3% | 2.9% | 6.5% | 2.1% | 6.3% | -4.8% | 6.9% | 16.2% | -0.8% |

Praktische Informationen

Verwahrstelle

Verwahrstelle ist CACEIS Bank, Luxembourg Branch.

Kurspublikation

Der Nettoinventarwert pro Anteil wird täglich berechnet und ist auf der Webseite www.loim.com abrufbar oder kann am Gesellschaftssitz der SICAV angefragt werden.

Weitere Informationen

Informationen über die SICAV, deren Teilfonds und die verfügbaren Anteilsklassen sind unter www.loim.com abrufbar. Dort ist auch beschrieben, wie man Anteile kauft oder verkauft oder wie man zwischen den SICAV-Teilfonds wechselt. Der Prospekt, die Jahres- und Halbjahresberichte der SICAV und die Details zur aktuellen Vergütungspolitik von Lombard Odier Funds (Europe) S.A. sind unter www.loim.com und am Sitz der SICAV (291, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg) kostenlos erhältlich (Englisch, Italienisch und Französisch). Die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des Teilfonds werden getrennt von jenen der anderen SICAV-Teilfonds gehalten. Kreditoren

haben keinen Zugriff auf die Vermögenswerte des Teilfonds.

Steuerrecht

Der Teilfonds unterliegt den luxemburger Steuervorschriften. Abhängig von Ihrem Wohnsitzland können die luxemburger Steuervorschriften Ihre Anlage beeinflussen. Wir raten Ihnen, die Hilfe eines Steuerberaters in Anspruch zu nehmen.

Haftung

Die SICAV haftet ausschliesslich auf der Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Aussagen, sofern diese irreführend oder ungenau sind oder von den entsprechenden Passagen im Fondsprospekt der SICAV abweichen.

Umtausch zwischen Teilfonds

Erfüllen die Anleger die im Fondsprospekt genannten Bedingungen, können sie ihre Anteile an diesem Teilfonds gegen eine andere Anteilsklasse desselben Teilfonds oder gegen Anteile eines anderen Teilfonds der SICAV umtauschen. Näheres zum Umtausch von Anteilen finden Sie in Abschnitt 14 "Umtausch von Aktien" des Fondsprospekts.

Dieser Fonds ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier reguliert.

Lombard Odier Funds (Europe) S.A. ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier reguliert.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 31. Januar 2022.