

LO Funds – Event Driven
 Syst. NAV Hdg, (EUR) M
 Ficha informativa (Material de marketing)

Liquid Alternatives Strategies • Alternatives

31 agosto 2026

DATOS DEL FONDO

Domicilio/Estatuto jurídico	Luxemburgo / SICAV
Legal Status	UCITS
Lanzamiento del fondo	1 octubre 2015
SFDR Classification	Article 6
Moneda del Fondo	USD
Moneda de la clase	EUR Hedged
Gestor del Fondo	G. Gedeon
Activos (todas las clases)	EUR 43.88 millones
Liquidez (suscr./reemb.)	semanal (Miércoles)
Inversión mínima	EUR 3'000
Gastos de entrada/salida	0.00% / 0.00%
Comisión de gestión	1.60%
Comisión de distribución	0.00%
FROC	0.35%
Comisión de resultados	20% High Watermark
Ongoing charge (31 julio 2026)	1.98%
TER max (31 marzo 2026)	1.95%

PERFIL DE RIESGO

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Bajo Alto

Este indicador resumido de riesgo (SRI) es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Als er minder dan 5 jaar aan gegevens beschikbaar zijn, worden de ontbrekende rendementen gesimuleerd met een passende benchmark. De synthetische indicator kan in de loop van de tijd veranderen en mag niet worden beschouwd als een indicator voor toekomstige risico's of opbrengsten. Zelfs de laagste risicoclassificatie betekent niet dat het Subfonds een risicoloze belegging vormt of dat het ingelegde kapitaal noodzakelijkerwijs gegarandeerd of beschermd is.

CÓDIGOS

ISIN	LU1924980664
Bloomberg	LOFECM LX
Valor liquidativo	EUR 11.39

STEUERLICHE INFORMATIONEN

ES - Switchable	No
-----------------	----

RATINGS

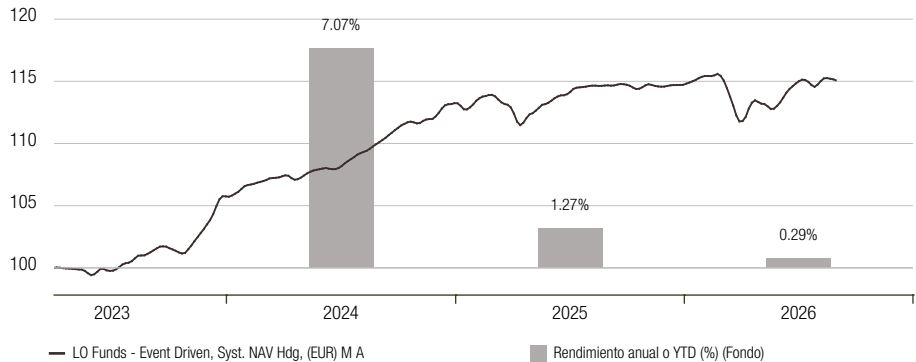
Morningstar Category	Alt - Event Driven
----------------------	--------------------

CARACTERÍSTICAS PRINCIPALES

LO Funds - Event Driven es una cartera OICVM gestionada activamente. La estrategia invierte de manera oportunista en diferentes valores de renta variable y crédito a lo largo de todo el ciclo de inversión. El universo de inversión es verdaderamente global y se centra en Europa y Asia. El objetivo de la estrategia es estructurar una convexidad positiva y maximizar la rentabilidad ajustada al riesgo invirtiendo en catalizadores o situaciones de valor relativo El gestor de carteras equilibra los riesgos de la cartera mediante la selección de posiciones, el dimensionamiento y la cobertura explícita contra caídas. La gestión del riesgo se refuerza aún más con la supervisión del equipo dedicado de gestión del riesgo de LOIM. El Gestor de Carteras, Georges Gedeon, cuenta con más de 25 años de experiencia en la identificación de ideas asimétricas a través de diferentes tipos de eventos, sectores y clases de activos.

El Fondo aplica la estrategia Event Driven bajo la dirección de Georges Gedeon desde el 1 de abril de 2023

RENDIMIENTO ACUMULADA Y ANUAL NETAS EN EUR 01-abr-2023 - 31-ago-2026



Las rentabilidades pasadas no garantizan rendimientos futuros. Los rendimientos se muestran netos de todos los costes excepto comisiones de entrada y salida. La rentabilidad está sujeta a impuestos y puede cambiar en el futuro. La rentabilidad puede aumentar o disminuir debido a las fluctuaciones de divisas.

NET RENDIMIENTO EN EUR	Acumulado	Anualizado
	Fondo	Fondo
Desde comienzos de año	0.29%	-
YTD	0.12%	-
1 mes	0.44%	-
3 meses	1.72%	-
1 año	0.29%	-
3 años	13.72%	4.36%
Rentabilidad total (desde 01.04.2023)	15.09%	4.18%

ESTADÍSTICAS 01.04.2023 - 31.08.2026

	Fondo
Volatilidad anualizada	3.20%
Ratio de Sharpe	0.39
Reducción máxima	-3.63%

RENDIMIENTOS MENSUALES EN %	2023 Fondo	2024 Fondo	2025 Fondo	2026 Fondo
Enero		0.8	0.1	0.6
Febrero		0.2	0.4	0.3
Marzo		0.4	-1.0	-3.6
Abril	-0.0	-0.1	-0.4	1.5
Mayo	-0.7	0.7	0.8	-0.0
Junio	0.5	0.0	0.5	1.5
Julio	0.7	1.1	0.5	-0.3
Agosto	0.7	0.8	0.2	0.4
Septiembre	0.5	1.0	0.0	
Octubre	-0.5	0.3	0.0	
Noviembre	2.3	0.4	-0.2	
Diciembre	2.3	1.2	0.2	
Año	5.8	7.1	1.3	0.3

Los siguientes riesgos pueden revestir una importancia significativa, pero pueden no estar siempre adecuadamente reflejados en el indicador de riesgo sintético y pueden ocasionar pérdidas adicionales:

Riesgos asociados al uso de derivados y técnicas financieras: Los derivados y otras técnicas financieras utilizados esencialmente para conseguir, aumentar o reducir la exposición a activos pueden ser difíciles de evaluar, pueden generar apalancamiento y pueden no producir los rendimientos previstos. Todas estas circunstancias podrían perjudicar la rentabilidad del fondo.

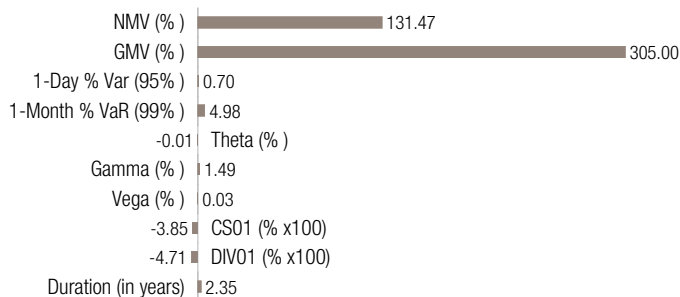
Riesgo de modelo: Los modelos pueden estar mal especificados, aplicarse inadecuadamente o, incluso, volverse inaplicables cuando se producen cambios en los mercados financieros o en la organización. En ese caso, el modelo podría afectar negativamente a la gestión de la cartera y generar riesgo de pérdidas.

Riesgos financiero, económico, de regulación y político: Los instrumentos financieros se ven afectados por diversos factores, incluidos, entre otros, la evolución del mercado financiero, la evolución económica de los emisores (que a su vez se ven afectados por la situación económica del mundo en general) y las condiciones económicas, de regulación y políticas predominantes en el país en cuestión.

Antes de tomar cualquier decisión de inversión, lea la última versión del folleto, los estatutos de constitución, los documentos de datos fundamentales (KID) y el último informe anual e informe semestral. Preste atención al Apéndice B «Anexo sobre factores de riesgo» del folleto.

La incorporación de riesgos no financieros en el proceso de toma de decisiones de inversión puede dar lugar a una infraponderación de inversiones rentables del universo de inversión del subfondo, así como a que el gestor del subfondo infrapondere inversiones que seguirán siendo rentables. Los riesgos de sostenibilidad pueden generar un considerable deterioro del perfil financiero o de la rentabilidad o la reputación de una inversión subyacente, por lo que pueden afectar significativamente a su precio de mercado o su liquidez.

El Fondo no es un producto financiero sujeto al Artículo 8 o al Artículo 9 del Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (el "SFDR"). Las inversiones subyacentes de este producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE relativos a las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

CONTRIBUCIÓN BRUTA MENSUAL A LA RENTABILIDAD (EN %)**EXPOSICIÓN DE LA CARTERA - VMN (EN %)****EXPOSICIÓN DE LA CARTERA - VMB (EN %)****PARÁMETROS DE RIESGO DEL FONDO**

GLOSARIO

Calificaciones crediticias: El desglose de calificaciones crediticias de fondos convertibles indicado es una combinación de calificaciones elaboradas internamente y de calificaciones de fuentes externas.

Perfil de riesgo y remuneración: Este indicador resumido de riesgo (SRI) es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Cuando los datos disponibles se refieren a un periodo inferior a 5 años, las rentabilidades que faltan se simulan utilizando un índice de referencia adecuado. El SRI puede cambiar con el tiempo y no debería utilizarse como indicador de la remuneración o el riesgo futuros. Incluso la clasificación de riesgo más baja no implica que el Subfondo esté libre de riesgo o que el capital se encuentre necesariamente garantizado o protegido.

Ratio de gastos totales: El total de comisiones relativas a la gestión y el funcionamiento del fondo. La ratio de gastos totales incluía la comisión de gestión anual y otros cargos, como gastos jurídicos, administrativos y de auditoría (fuente: informes anuales auditados o informes semestrales no auditados)

Volatilidad: Medida estadística de las fluctuaciones del precio de un título. También puede utilizarse para describir las fluctuaciones de un mercado determinado. Una volatilidad elevada indica mayor riesgo.

Ratio de Sharpe: Medida de la rentabilidad ajustada por el riesgo. Cuanto mayor es la ratio, mejor se ha ajustado la rentabilidad al riesgo.

Pérdida: Un descenso normalmente se define como el porcentaje entre el máximo y el mínimo de una inversión durante un periodo determinado. Puede servir para comparar la posible remuneración de una inversión con su riesgo.

Correlación: La correlación mide el modo en que los títulos o las clases de activos se mueven en relación unos con otros. Las inversiones con una fuerte correlación tienden a subir y bajar al mismo tiempo, mientras que las inversiones de correlación baja tienden a comportarse de formas diferentes en condiciones de mercado distintas, lo que ofrece a

los inversores la ventaja de la diversificación. La correlación se mide entre 1 (correlación perfecta) y -1 (correlación negativa perfecta). Un coeficiente de correlación 0 sugiere que no existe correlación.

Tracking error: Medida de la cercanía con la que una cartera de inversiones sigue a su índice de referencia.

Suelo del bono: El valor más bajo al que puede llegar un bono convertible, dado el valor presente de los flujos de efectivo futuros restantes y el reembolso del principal. El suelo del bono es el nivel al que la opción convertible pierde su valor debido a que el precio del título subyacente ha caído sustancialmente por debajo del valor de conversión.

Delta: La ratio que compara la variación del precio del activo subyacente con la correspondiente variación del precio de un derivado.

Prima: Si un título de renta fija (bono) se adquiere con prima, los tipos de interés existentes son más bajos que el tipo del cupón. Los inversores pagan una prima por una inversión que les proporcionará una rentabilidad mayor que los tipos de interés existentes. Rendimiento hasta el vencimiento: La tasa de rentabilidad prevista de un bono si este se mantiene hasta la fecha de su vencimiento.

Cupón: El tipo de interés establecido para un bono en el momento de su emisión.

Duración modificada: Esta fórmula se utiliza para determinar el efecto que tendrá una variación de 100 puntos básicos (1%) de los tipos de interés en el precio de un bono.

Duración media: La duración modificada media de la cartera expresada en años.

Pérdida prevista: Pérdida media anual prevista para la cartera expresada en porcentaje.

Nivel de subordinación (attachment point): La probabilidad modelada de una rentabilidad negativa de la cartera en cualquier año.

RENUNCIA

Este documento es una **Comunicación de Marketing** relativa a **Lombard Odier Funds** y su **Subfondo ("LO Funds - Event Driven")** (conjuntamente denominados el "Fondo"). Este documento está destinado únicamente a Inversores Profesionales y minoristas en los países de la UE/EEE donde el Fondo está registrado para su distribución, según lo establecido en la Directiva sobre Mercados de Instrumentos Financieros 2014/65/UE (MiFID), y no está destinado a inversores minoristas ni a Personas de EE. UU., según la definición del Reglamento S de la Ley de Valores de los Estados Unidos de 1933, en su versión modificada.

Este documento ha sido emitido por **Lombard Odier Funds (Europe) S.A** (en adelante, la "Sociedad Gestora"). La Sociedad Gestora está autorizada y regulada por la Commission de Surveillance du Secteur Financier (la "CSSF") conforme a la Directiva 2009/65/CE de la UE y tiene su domicilio social en 291, Route d'Arlon, L-1150 Luxemburgo. La Sociedad Gestora forma parte de la División de Gestión de Inversiones de Lombard Odier ("LOIM") del Grupo Lombard Odier. LOIM es un nombre comercial. Las entidades de LOIM colaboran en la preparación de este documento y LOIM es un nombre comercial. El Fondo está autorizado y regulado por la CSSF como un UCITS conforme a la Directiva 2009/65/CE de la UE, en su versión modificada.

Este documento es propiedad de LOIM, se proporciona únicamente con fines informativos y está dirigido al destinatario exclusivamente para su uso personal. No puede reproducirse (total o parcialmente), transmitirse, modificarse ni utilizarse para ningún otro propósito sin el permiso previo por escrito de LOIM. No está destinado a distribución, publicación ni uso para ningún otro propósito sin el permiso previo por escrito de LOIM.

El contenido de este documento no ha sido revisado por ninguna autoridad reguladora en ninguna jurisdicción y no constituye una oferta ni una recomendación para suscribirse a ningún valor u otros instrumentos financieros o productos descritos en el mismo. Contiene opiniones de LOIM, a la fecha de emisión. Estas opiniones e información contenida en este documento no tienen en cuenta todas las circunstancias específicas del destinatario. Por lo tanto, no se hace ninguna declaración de que las estrategias de inversión presentadas en este documento sean adecuadas o apropiadas para las circunstancias individuales de cualquier inversor. El tratamiento fiscal depende de las circunstancias individuales del inversor y puede estar sujeto a cambios en el futuro. LOIM no proporciona asesoramiento fiscal. En consecuencia, debe verificar lo anterior y toda la información proporcionada en este documento con los documentos legales emitidos para el Fondo o revisarlo con sus asesores fiscales externos.

La información y el análisis contenidos en este documento se basan en fuentes que se consideran fiables. Aunque LOIM hace todo lo posible para garantizar que el contenido se cree de buena fe, con el mayor cuidado y precisión, no garantiza la actualidad, validez, fiabilidad ni integridad de la información contenida en este documento, ni garantiza que la información esté libre de errores y omisiones, ni acepta ninguna responsabilidad por cualquier pérdida o daño resultante de su uso. Toda la información y opiniones, así como los precios indicados, pueden cambiar sin previo aviso. Ciertos contenidos de terceros están marcados como tales. LOIM no asume ninguna responsabilidad por daños indirectos, incidentales o consecuentes que sean causados por o en relación con el uso

de dicho contenido.

La fuente de los datos se ha mencionado donde estaba disponible. A menos que se indique lo contrario, los datos son preparados por LOIM.

Una inversión en el Fondo no es adecuada para todos los inversores. La propiedad de cualquier decisión de inversión recaerá exclusivamente en el inversor. La inversión debe realizarse después de analizar todos los posibles factores de riesgo y ejerciendo discreción independiente. El inversor debe asegurarse particularmente de la idoneidad de una inversión con respecto a su situación financiera, perfil de riesgo y objetivos de inversión. **No se puede garantizar que se logre el objetivo de inversión del Fondo o que haya un retorno sobre el capital. El rendimiento pasado o estimado no es necesariamente indicativo de resultados futuros y no se puede garantizar que se obtengan beneficios ni que no se incurran en pérdidas sustanciales.** El inversor asume el riesgo de pérdidas en relación con cualquier inversión. La información contenida en este documento no constituye ningún tipo de asesoramiento sobre ninguna inversión ni las consecuencias relacionadas de tomar una decisión de inversión particular en cualquier Fondo. Cada inversor debe hacer su propia evaluación de riesgos, objetivos, liquidez, impuestos y otros méritos financieros de sus decisiones de inversión. Las opiniones, puntos de vista y estimaciones pueden cambiar sin previo aviso y se basan en una serie de suposiciones que pueden o no materializarse o resultar precisas. Los escenarios presentados son una estimación del rendimiento futuro basada en evidencia del pasado sobre cómo varía el valor de esta inversión, y/o las condiciones actuales del mercado y no son un indicador exacto. Lo que obtendrá variará dependiendo de cómo se desempeñe el mercado y cuánto tiempo mantenga la inversión/producto.

Las inversiones están sujetas a una variedad de riesgos

Las inversiones mencionadas en este documento pueden conllevar riesgos que son difíciles de cuantificar e integrar en una evaluación de inversión. En general, productos como acciones, bonos, forex o instrumentos del mercado monetario llevan riesgos, que son mayores en el caso de productos derivados, estructurados y de capital privado; estos están dirigidos únicamente a inversores que puedan comprender su naturaleza y características y soportar sus riesgos asociados. A solicitud, LOIM estará encantado de proporcionar a los inversores información más detallada sobre los riesgos asociados con los instrumentos dados. La liquidez de una inversión está sujeta a la oferta y la demanda. Algunos productos pueden no tener un mercado secundario bien establecido o, en condiciones extremas de mercado, pueden ser difíciles de valorar, lo que resulta en volatilidad de precios y dificulta obtener un precio para deshacerse del activo.

Cuando el Fondo está denominado en una moneda distinta a la moneda base de un inversor, los cambios en la tasa de cambio pueden tener un efecto adverso en el precio y los ingresos. Todas las cifras de rendimiento reflejan la reinversión de intereses y dividendos y no tienen en cuenta las comisiones y los costos incurridos en la emisión y el rescate de acciones/unidades; las cifras de rendimiento son estimadas y no auditadas. El rendimiento neto muestra el rendimiento neto de comisiones y gastos para el fondo/clase de acciones relevante durante el período de referencia. Este documento no contiene recomendaciones personalizadas ni asesoramiento y no está destinado a sustituir ningún asesoramiento profesional sobre inversiones en productos financieros. Ni esta

comunicación de marketing ni este documento ni ninguna parte de él formarán la base de, o se confiarán en relación con, cualquier contrato para comprar o suscribirse al Fondo. No todos los costos están listados en este documento y se recomienda al inversor consultar los documentos de oferta para obtener más información.

Los estatutos, el prospecto, el Documento de Información Clave ("PRIIPS/KIDs") y el formulario de suscripción son los únicos Documentos de Oferta oficiales de las acciones del Fondo (los "Documentos de Oferta"). Ninguna parte está autorizada para proporcionar información o hacer garantías que no estén contenidas en los Documentos de Oferta.

Acceso a documentos en el país de registro

Los **PRIIPS/KIDs** están disponibles en uno de los idiomas oficiales de su país y un Prospecto está disponible en inglés, francés, alemán e italiano. Los **PRIIPS/KIDs** y el Prospecto, junto con los Estatutos y el último informe financiero anual y semestral, están disponibles en www.loim.com o pueden solicitarse gratuitamente en el domicilio social del Fondo o de la Sociedad Gestora, a través de los distribuidores del Fondo o de los representantes locales mencionados a continuación. Estos Documentos de Oferta se proporcionan con fines informativos e ilustrativos y no constituyen un documento contractual vinculante ni una información exigida por ninguna disposición legislativa, y no son suficientes para tomar una decisión de inversión.

Consulte el prospecto y los **PRIIPS/KIDs** antes de tomar cualquier decisión de inversión definitiva. Antes de invertir en el Fondo, el inversor debe leer todos los Documentos de Oferta y, en particular, los factores de riesgo relacionados con la inversión en el Fondo, considerar cuidadosamente la idoneidad de dicha inversión para sus circunstancias personales y, si es necesario, obtener asesoramiento profesional independiente sobre los **riesgos**, así como sobre las **consecuencias legales, regulatorias, fiscales, contables y crediticias**.

LOIM reconoce que pueden existir conflictos de interés como consecuencia de la distribución del Fondo emitido o gestionado por entidades del Grupo Lombard Odier. LOIM dispone de una **política de Conflictos de Interés** para identificar y gestionar dichos conflictos, y una copia de esta política está disponible en <https://am.lombardodier.com/home/asset-management-regulatory-disc.html>.

Un resumen de los derechos de los inversores en relación con reclamaciones y litigios está disponible en inglés en <https://am.lombardodier.com/home/asset-management-regulatory-disc.html>.

Este Fondo está clasificado como un producto del Artículo 6 conforme al Reglamento (UE) 2019/2088 del Parlamento Europeo y del Consejo de 27 de noviembre de 2019 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros ("SFDR"). Como tal, no promueve características medioambientales o sociales, ni tiene un objetivo de inversión sostenible.

Un resumen de la información sobre sostenibilidad a nivel de entidad está disponible en inglés en la sección 'Regulatory and voluntary' de la página web del Fondo, en la dirección [Regulatory Disclosures - Asset Management - Lombard Odier](#).

Limitación en la Venta

Las acciones emitidas por este Fondo solo pueden ser ofrecidas o vendidas públicamente en países en los que dicha oferta pública o venta esté permitida. Por lo tanto, a menos que la Sociedad Gestora o los representantes de la Sociedad Gestora hayan presentado una solicitud ante las autoridades supervisoras locales y se haya otorgado el permiso por parte de las autoridades supervisoras locales, y mientras no se haya presentado dicha solicitud o no se haya otorgado dicho permiso por parte de las autoridades supervisoras, este Fondo no representa una oferta para comprar acciones de inversión.

No para Persona de US

El Fondo no ha sido registrado conforme a la Ley de Valores de Estados Unidos de 1933. Este documento no está destinado a ninguna "Persona de US" según lo definido en la Regulación S de la Ley, según enmendada, ni conforme a la Ley de Compañías de Inversión de Estados Unidos de 1940, según enmendada, y no será registrado conforme a la Ley de Compañías de Inversión de Estados Unidos de 1940, según enmendada, ni conforme a otras leyes federales de EE.UU. Por lo tanto, las acciones no serán ofrecidas ni vendidas públicamente en los Estados Unidos. Ni este documento ni ninguna copia del mismo puede ser enviada, llevada o distribuida en los Estados Unidos de América, cualquiera de sus territorios o posesiones o áreas sujetas a su jurisdicción, ni a o para el beneficio de una Persona de los Estados Unidos. Para este propósito, el término "Persona de los Estados Unidos" significará cualquier ciudadano, nacional o residente de los Estados Unidos de América, sociedad organizada o existente en cualquier estado, territorio o posesión de los Estados Unidos de América, una corporación organizada bajo las leyes de los Estados Unidos o de cualquier estado, territorio o posesión de los mismos, o cualquier patrimonio o fideicomiso que esté sujeto al impuesto sobre la renta federal de los Estados Unidos independientemente de la fuente de sus ingresos.

El Fondo está actualmente notificado para su comercialización en **varias jurisdicciones**. La Sociedad Gestora puede decidir en cualquier momento poner fin a los acuerdos establecidos para la comercialización del Fondo utilizando el procedimiento previsto en el artículo 93a de la Directiva UCITS.

Cuando el Fondo esté registrado en las siguientes jurisdicciones, estará representado por los siguientes representantes:

España. Representante: Allfunds Bank, S.A.U., C/de los Padres Dominicos, 7, 28050 Madrid. Autoridad de supervisión: Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV).

Protección de datos

Es posible que esté recibiendo esta comunicación porque nos ha proporcionado sus datos de contacto. En tal caso, tenga en cuenta que podemos tratar sus datos personales con fines de marketing directo. Para más información sobre la política de protección de datos de Lombard Odier, consulte www.lombardodier.com/privacy-policy

©2026 Lombard Odier IM. All rights reserved.