

LO Prévoyance – My Private Pension Defensive Z

Reporting mensuel (document marketing)

Stratégie Active • Allocation d'actifs

31 juillet 2021

DONNÉES DU FONDS

Domicile/Statut juridique	Suisse / FCP
Date de lancement du fonds	7 février 2019
Classification SFDR	-
Monnaie du fonds	CHF
Monnaie de la classe	CHF
Enregistré en	CH
Gérant	C. Caillault, H. Hysi Ferrero, L. Cattin
Encours (toutes classes)	CHF 104.82 millions
Liquidité (souscr./rbt.)	Quotidienne, 15:00
Inv. minimum	1 part
Commission de gestion	0.05%
Commission de distribution	0.00%
FROC	0.10%
TER max (31 décembre 2020)	0.65%

PROFIL DE RISQUE

1	2	3	4	5	6	7
Faible			Elevé			

CODES

	Classe A
ISIN	CH0445993501
Bloomberg	LOMPDZC SW
Telekurs	44599350
VNI	CHF 11.28

POINTS CLÉS

PHILOSOPHIE

• L'objectif du compartiment est d'augmenter votre capital grâce à des revenus et la croissance des actifs. À travers une gestion active concentrée sur les besoins d'un individu et en améliorant le ratio rendement/risque du portefeuille, le compartiment investit avec conviction dans un large univers d'actifs diversifiés, directement ou par l'intermédiaire de parts de placements collectifs de capitaux.

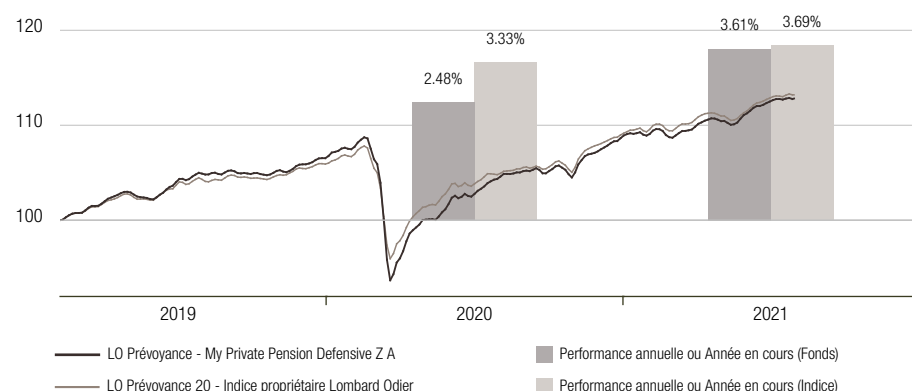
PROFIL

• En moyenne, 20% des avoirs sont investis en actions et les gestionnaires appliquent une gestion des risques stricte fondée sur la mesure d'expected shortfall.

CADRE

• Conforme aux principes d'investissements applicables aux fonds de pensions suisses (LPP/OPP2).

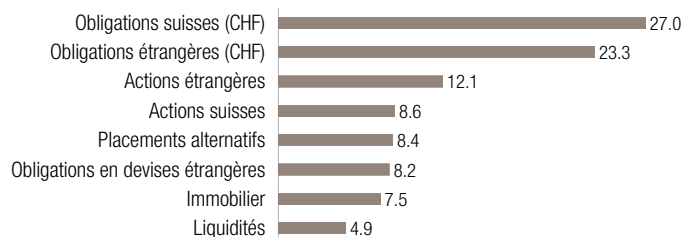
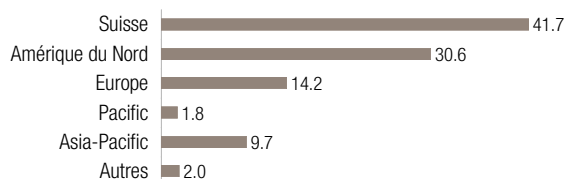
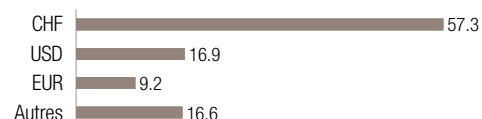
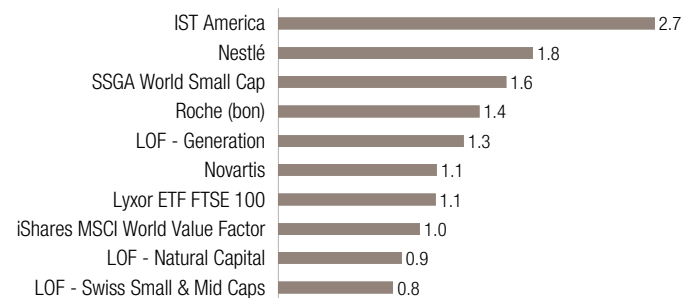
PERFORMANCE NETTE ET PERFORMANCE ANNUELLE EN CHF 7 févr. 2019 - 31 juil. 2021



PERFORMANCE NETTE EN CHF	Cumulée		Annualisée	
	Fonds	Indice	Fonds	Indice
Année en cours	3.61%	3.69%	-	-
1 mois	0.31%	0.32%	-	-
3 mois	2.24%	2.07%	-	-
1 an	8.16%	8.14%	-	-
Perf. totale (depuis 07.02.2019)	12.81%	13.20%	4.96%	5.11%

STATISTIQUES 07.02.2019 - 31.07.2021

	Fonds	Indice
Baisse maximum	-9.74%	-7.47%
Corrélation		0.987
Tracking Error		1.71%

ACTIFS (EN %)**RÉPARTITION MONÉTAIRE (EN %)****RÉPARTITION RÉGIONALE DE LA PART ACTIONS (EN %)****RÉPARTITION MONÉTAIRE DE LA PART OBLIGATAIRE (%)****10 PRINCIPALES POSITIONS ACTIONS (EN %)****PERFORMANCE MENSUELLE EN %**

	2019		2020		2021	
	Fonds	Indice	Fonds	Indice	Fonds	Indice
Janvier			0.9	0.7	-0.4	-0.3
Février	0.7	0.6	-1.5	-1.5	-0.3	0.1
Mars	1.0	1.0	-8.4	-6.0	1.4	1.4
Avril	1.3	1.1	3.5	3.3	0.7	0.4
Mai	-0.8	-0.8	1.3	1.3	0.7	0.3
Juin	1.7	1.5	1.2	0.7	1.2	1.4
Juillet	1.2	1.0	1.6	0.9	0.3	0.3
Août	0.2	0.2	0.6	0.6		
Septembre	-0.3	-0.1	0.2	0.2		
Octobre	0.2	0.1	-0.9	-0.7		
Novembre	0.8	0.9	2.8	3.0		
Décembre	0.2	0.0	1.6	1.2		
An	6.2	5.7	2.5	3.3	3.6	3.7

RISQUES PARTICULIERS

Les risques suivants peuvent être importants mais ne sont pas nécessairement pris en considération de manière adéquate par l'indicateur synthétique et peuvent entraîner des pertes supplémentaires:

- Risque de gestion active: la gestion active repose sur l'anticipation de divers développements de marchés et/ou la sélection des titres. Il existe un risque, à tout

GLOSSAIRE

Profil de risque et de rendement : Cet indicateur (SRRI) représente la volatilité annuelle historique du Compartiment au cours des cinq dernières années. Si les données remontent à moins de cinq ans, les rendements manquants sont simulés à l'aide d'un indice approprié. Le SRRI peut varier au fil du temps et ne doit pas être utilisé comme un indicateur du risque ou des rendements futurs. Même la classification du risque la plus faible ne signifie pas que le Compartiment est dénué de tout risque ou que le capital est nécessairement garanti ou protégé.

Volatilité : Mesure statistique des fluctuations du cours d'un titre. Elle peut aussi être utilisée pour décrire les fluctuations sur un marché particulier. Une volatilité élevée est un signe de risque plus élevé.

Ratio de Sharpe : Mesure la performance ajustée du risque. Plus le ratio est élevé, meilleure est la performance ajustée du risque.

Baisse maximum : Une baisse est souvent mentionnée en tant que pourcentage entre le sommet et le creux d'un investissement sur une période spécifique. Cela peut aider à comparer le rendement possible d'un investissement par rapport à son risque.

Corrélation : La corrélation évalue comment les titres ou classes d'actifs évoluent les uns

AVERTISSEMENT**INFORMATION IMPORTANTE**

Sous la dénomination LO Prévoyance, il existe un fonds ombrelle contractuel relevant de la catégorie "autres fonds en placements traditionnels" (ci-après "le fonds ombrelle") destiné exclusivement à des investisseurs qualifiés, au sens des articles 25 ss, 68 ss et 10 alinéa 3, 3 bis, 3 ter et 4 de la Loi fédérale sur les placements collectifs de capitaux du 23 juin 2006 (LPCC). Les compartiments du fonds et leurs gestionnaires de placements collectifs sont les suivants: Balanced Lombard Odier Asset Management (Europe) Ltd, à Londres, Balanced + Lombard Odier Asset Management (Europe) Ltd, à Londres, My Private Pension Defensive Banque Lombard Odier & Cie SA, à Genève, My Private Pension Medium Banque Lombard Odier & Cie SA, à Genève (ci-après le « Compartiment »), My Private Pension Extension Banque Lombard Odier & Cie SA, à Genève.

Le présent document est publié par le Gérant du compartiment cité dans ledit document, Banque Lombard Odier & Cie S.A., un établissement une banque et négociants en valeurs mobilières soumise à la réglementation de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (FINMA).

Le présent document est fourni à titre d'information uniquement. Il n'est pas une recommandation de souscription et ne constitue pas une offre d'achat ou de vente, ni une invitation à souscrire des parts du Compartiment. Ni ce document, ni aucune partie de ce document ne saurait constituer une base ou ne saurait être considéré comme décisif pour l'acquisition ou la souscription de parts du Compartiment. Une telle acquisition ne peut être réalisée que sur la base des documents officiels du Compartiment, dans leur version finale. Les statuts, le prospectus, le document d'informations clés pour l'investisseur, le formulaire de souscription ainsi que les derniers rapports annuels et semi-annuels sont les seuls documents officiels de vente des parts du Compartiment (ci-après les « Documents d'offre »). Ils sont disponibles sur www.loim.com ou peuvent être obtenus gratuitement auprès du siège social du Compartiment ou de la Société de gestion au Luxembourg: 291, route d'Arlon L-1150 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg. Les informations fournies dans ce document ne tiennent pas compte de circonstances, objectifs ou besoins spécifiques individuels et ne constituent pas une analyse selon laquelle un investissement ou une stratégie conviendrait ou seraient appropriés à des circonstances personnelles, et ne donnent aucune garantie qu'un investissement ou une stratégie constitue une recommandation personnalisée pour un investisseur. Ce document ne contient pas de recommandations ou de conseils personnalisés et n'est pas destiné à remplacer un conseil professionnel au sujet d'investissements dans des produits financiers.

Avant d'investir dans le Compartiment, tout investisseur doit lire attentivement les Documents d'offre, et en particulier les facteurs de risque liés à un investissement dans ledit Compartiment; il doit aussi prêter attention à la nature à long terme de l'obtention de rendements solides sur l'ensemble du cycle économique et noter que le recours à des instruments dérivés dans le cadre de la stratégie de placement pourrait entraîner une hausse du niveau d'endettement et augmenter l'exposition globale au risque du Compartiment ainsi que la volatilité de sa valeur d'actif net. Il incombe aux investisseurs de vérifier si un tel placement est adapté à leur propre profil de risque et à leur situation personnelle et, si nécessaire, d'obtenir un avis professionnel indépendant quant aux risques et aux conséquences juridiques, réglementaires, fiscales, comptables ainsi qu'en matière de crédit. Il ne peut y avoir de garantie que l'objectif d'investissement du Compartiment soit atteint ou qu'il y ait un retour sur capital. La performance passée ne

moment, que le fonds ne soit pas investi dans les marchés ou titres les plus performants. La valeur d'actif net du fonds risque donc de baisser.

- Risque de crédit: un degré important d'investissement dans les titres de créance ou titres risqués implique un impact sensible du risque de défaut ou du défaut réel sur la performance. La probabilité de l'impact dépend de la solvabilité des émetteurs.

par rapport aux autres. Les investissements fortement corrélés ont tendance à augmenter et à diminuer de concert tandis que les investissements avec une faible corrélation ont tendance à enregistrer des performances différentes dans des conditions de marché différentes, ce qui offre des avantages en termes de diversification aux investisseurs. L'échelle de corrélation va de 1 (corrélation parfaite) à -1 (corrélation parfaitement opposée). Un coefficient de corrélation de 0 indique qu'il n'y a pas de corrélation.

FROC (Taux fixe du coût opérationnel): Les Coûts opérationnels couvrent les dépenses directement encourues par la Société ("Coûts directs") et celles résultant des activités exercées par la Société de gestion pour le compte de la Société ("Coûts des services au fonds").

Expected shortfall: Perte moyenne que le portefeuille est susceptible d'enregistrer une fois tous les vingt ans (autrement dit, la perte moyenne dans les 5% des années les plus défavorables). Calculé avec un intervalle de confiance de 95 %. Certains événements, tels que la récente crise COVID-19, peuvent engendrer une volatilité de marché exceptionnelle et impacter les niveaux d'expected shortfall.

constitue pas une indication fiable quant à la performance future. Lorsque le Compartiment est libellé dans une monnaie autre que la monnaie de référence de l'investisseur, les variations du taux de change peuvent avoir un impact négatif sur le prix et les revenus. Veuillez prendre en compte les facteurs de risque. Tous les indices de référence/indices cités dans le présent document sont fournis à titre informatif uniquement. Aucun indice de référence/indice n'est directement comparable avec les objectifs de placement, la stratégie ou l'univers d'un Compartiment. La performance d'un indice de référence ne constitue pas une indication de la performance passée ou future du Compartiment. Il ne saurait être présumé que le Compartiment investira dans un quelconque titre entrant dans la composition d'un indice quel qu'il soit ni qu'il existe une corrélation entre la performance du Compartiment et celle de l'indice. Le ratio objectif de performance/risque constitue un objectif de construction du portefeuille. Il ne représente pas le rapport performance/risque passé et ne saurait préjuger du rapport performance/risque futur. Lombard Odier reconnaît que des conflits d'intérêts peuvent exister du fait de la distribution d'instruments ou produits financiers émis et/ou gérés par des entités appartenant au Groupe Lombard Odier. Par conséquent, Lombard Odier met en œuvre toutes les mesures raisonnables permettant d'identifier les conflits d'intérêts, et maintient et applique des contrôles efficaces concernant ces conflits d'intérêts.

Le Compartiment cité dans le présent document de marketing est enregistré à la distribution dans les pays suivants auprès des Autorités respectives : **Suisse** – Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (FINMA). Banque dépositaire : Banque Lombard Odier & Cie SA. Direction de Fonds : Lombard Odier Asset Management (Switzerland) S.A.. Veuillez-vous référer au Contrat de Fonds de placement.

Suisse : Le présent document a été approuvé pour utilisation en Suisse par Banque Lombard Odier & Cie SA Genève, une banque et négociants en valeurs mobilières soumise à la réglementation de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (FINMA).

Etats-Unis : Ni ce document ni aucune copie de ce dernier ne peuvent être envoyés, emmenés ou distribués aux Etats-Unis ou remis à une US-Person.

Le présent document de marketing ne peut être reproduit (en totalité ou en partie), transmis, modifié ou utilisé à des fins publiques ou commerciales sans l'autorisation écrite et préalable de Lombard Odier.

Protection des données:

Il se peut que vous receviez cette communication parce que vous nous avez fourni vos coordonnées. Si tel est le cas, veuillez noter que nous sommes susceptibles de traiter vos données à caractère personnel à des fins de marketing direct. Si vous souhaitez vous opposer à ce traitement, veuillez-vous adresser au responsable de la protection des données du Groupe : Banque Lombard Odier & Cie SA, Group Data Protection Officer, 11, Rue de la Corraterie, 1204 Genève, Suisse. E-mail : group-dataprotection@lombardodier.com. Pour de plus amples informations sur la politique de protection des données de Lombard Odier, veuillez consulter le site www.lombardodier.com/privacy-policy.

© 2021 Banque Lombard Odier & Cie SA – Tous droits réservés. Réf. LOCH-Fifund-fr-062019.