

# LO Funds (CH) – Swiss Equities Tracker+ ESG Z

## Fact Sheet (Marketingmaterial)

Systematic • Aktien

30. September 2024

### FONDSDATEN

Fondsdomizil/Rechtsform	Schweiz / FCP
Legal Status	Übrige Anlagefonds für traditionelle Anlagen
Lancierung des Fonds	22. März 2010
Währung des Fonds	CHF
Währung der Klasse	CHF
Fondsmanager	A. Medvedev, N. Mieszkalski
Vermögen (alle Klassen)	CHF 74.90 Millionen
Liquidität (Zeich./Rück.)	täglich, 12:00
Mindestanlagebetrag	Under IMA
Ausgabe / Rücknahmeaufschläge	0.00% / 0.00%
Verwaltungskommission	0.00%
Vertriebsgebühr	0.00%
Pauschalkommission	0.08%
Ongoing charge (30. August 2024)	0.09%
TER max (31. Januar 2024)	0.08%
Transaktionsgebühr (Zeich./Rück.)	0.02%

### RISIKOPROFIL

1	2	3	4	5	6	7
Niedrig						Hoch

### CODES

ISIN	CH0111012503
Bloomberg	LOSWEZD SW
Telekurs	11101250
NIW	CHF 206.05

### STEUERLICHE INFORMATIONEN

UK - Reporting Status	Nein
DE - Investment-steuergesetz (InvStG)	Equity Fund
Letzte Dividende (10.11.2023)	CHF 5.22

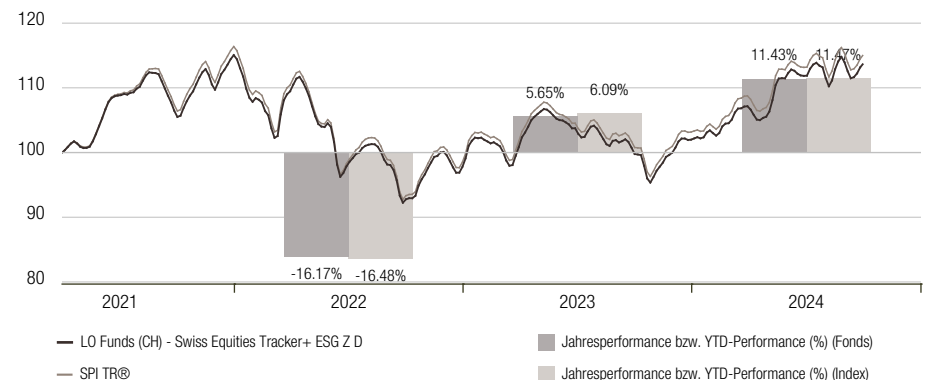
### RATINGS

Morningstar Rating	★ ★ ★ ★ ★
Morningstar Category	EAA Fund Switzerland Large-Cap Equity

### HIGHLIGHTS

LOF (CH) - Swiss Equities Tracker+ ESG ist ein systematisches, Long-only-Portfolio aus Schweizer Aktien. Die Strategie wurde im April 2021 lanciert. Der Fonds ist bestrebt, die Wertentwicklung des SPI Index mit einem Tracking Error von 0,50% nachzubilden und gleichzeitig die nichtfinanziellen Risiken und Chancen zu mindern bzw. zu nutzen. Um dieses Ziel zu erreichen, investiert der Fonds direkt und ausschliesslich in Wertpapiere des SPI Index. Dazu verwendet er einen firmeneigenen systematischen Ansatz, der die Gewichtung der Wertpapiere selektiv anpasst (bzw. Wertpapiere ausschliesst). Entscheidend sind folgende drei Kriterien: sogenannte wesentlichkeitsbasierte ESG-Faktoren, das heisst solche die eine materielle Relevanz im Bereich Umwelt, Soziales, Governance haben, das Gewicht der Kontroversen und die Kohlendioxidintensität (Scope 1 bis 3). Das Risikomanagement wird von den Fondsmanagern auf Portfolioebene in Zusammenarbeit mit unabhängigen Teams durchgeführt, die die Anlage-, Gegenpartei- und die operationellen Risiken überwachen. Securities Lending wird nicht implementiert.

### KUMULIERTE NETTO / JAHRES-PERFORMANCE IM CHF 01.04.2021 - 30.09.2024



NETTO-PERFORMANCE IN CHF	Kumulierte		Annualisierte	
	Fonds	Index	Fonds	Index
Seit Anfang Jahr	11.43%	11.47%	-	-
YTD	11.43%	11.47%	-	-
1 Monat	-1.54%	-1.59%	-	-
3 Monate	2.03%	2.03%	-	-
1 Jahr	12.83%	13.04%	-	-
3 Jahren	7.60%	7.96%	2.46%	2.58%
Gesamtrendite (seit 01.04.2021)	13.64%	15.00%	3.71%	4.06%

STATISTIKEN 01.04.2021 - 30.09.2024	Fonds	Index	Fonds
Annualisierte Volat.	12.17%	12.37%	Anzahl der Positionen
Sharpe Ratio	0.27	0.29	94
Max. drawdown	-19.49%	-19.93%	
Korrelation		0.999	
Tracking Error		0.64%	

MONATLICHE RENDITE IN %	2021		2022		2023		2024	
	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index
Januar			-5.6	-5.7	5.4	5.5	1.6	1.4
Februar			-2.1	-2.2	-1.3	-1.3	0.3	0.6
März			2.6	2.4	1.7	1.7	3.6	3.9
April	0.2	0.4	0.7	0.4	3.6	3.6	-2.3	-2.4
Mai	3.5	3.5	-4.4	-4.4	-1.9	-1.9	6.3	6.1
Juni	4.6	4.6	-7.1	-7.3	0.6	0.5	-0.5	-0.5
Juli	1.3	1.5	3.7	4.4	0.4	0.4	2.6	2.7
August	2.1	2.4	-2.8	-3.1	-2.0	-1.8	1.0	0.9
September	-5.8	-5.7	-5.8	-6.0	-1.9	-2.0	-1.5	-1.6
Oktober	3.7	3.8	4.7	4.8	-5.2	-5.2		
November	-0.6	-0.5	2.9	2.9	4.6	4.6		
Dezember	5.8	5.9	-3.3	-3.3	2.1	2.4		
<b>Jahr</b>	<b>15.1</b>	<b>16.4</b>	<b>-16.2</b>	<b>-16.5</b>	<b>5.7</b>	<b>6.1</b>	<b>11.4</b>	<b>11.5</b>

Die nachfolgend aufgeführten Risiken können wesentliche Auswirkungen haben, sind aber nicht immer angemessen im synthetischen Risikoindikator abgebildet und können deshalb zusätzliche Verluste verursachen:

**Konzentrationsrisiko:** Sind die Fondsanlagen in einem Land, Markt, Sektor, einer Anlageklasse oder Branche konzentriert, kann der Fonds einem Verlustrisiko ausgesetzt sein, wenn ungünstige Ereignisse eintreten, von denen das Land, der Markt, die Branche, der Sektor oder die Anlageklasse betroffen sind.

**Datenrisiko:** Die Einschätzung nichtfinanzieller Risiken ist komplex und kann sich auf Daten zu Umwelt, Sozialem oder Governance stützen, die schwierig zu finden, unvollständig, ungeprüft, nicht mehr aktuell oder sachlich unzutreffend sind. Selbst wenn die Daten vorliegen, gibt es keine Gewähr, dass sie richtig evaluiert werden.

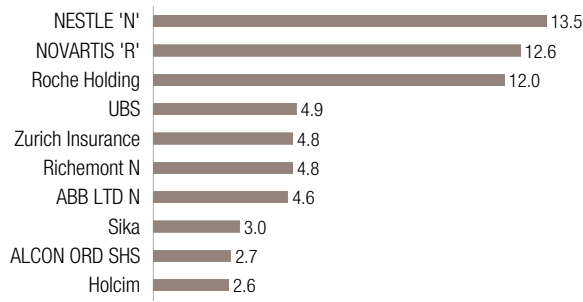
**Nachhaltigkeitsrisiko:** Die Berücksichtigung nichtfinanzieller Daten in Anlageentscheidungen kann zur Untergewichtung rentabler Investitionen aus dem Anlageuniversum des Teilfonds führen oder die Leitung des Teilfonds veranlassen, Investments, deren Wert weiterhin steigt, unterzugewichten. Nachhaltigkeitsrisiken können zu einer deutlichen Verschlechterung des Finanzprofils, der Rentabilität oder der Reputation einer zugrunde liegenden Anlage führen und können sich daher merklich auf den Marktpreis oder die Liquidität auswirken.

Bevor Sie eine Anlageentscheidung treffen, lesen Sie bitte die aktuelle Version des Fondsprospekts, die Satzung, die Wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger (Key Information Documents – KID) sowie den letzten Jahres- und Halbjahresbericht. Bitte beachten Sie den Anhang B „Risikofaktoren“ des Fondsprospekts.

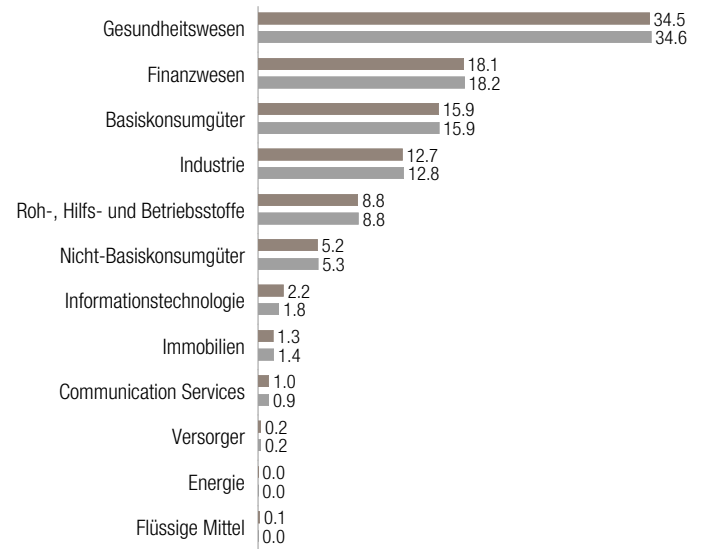
Die Berücksichtigung nichtfinanzieller Daten in Anlageentscheidungen kann zur Untergewichtung rentabler Investitionen aus dem Anlageuniversum des Teilfonds führen oder die Leitung des Teilfonds veranlassen, Investments, deren Wert weiterhin steigt, unterzugewichten. Nachhaltigkeitsrisiken können zu einer deutlichen Verschlechterung des Finanzprofils, der Rentabilität oder der Reputation einer zugrunde liegenden Anlage führen und können sich daher merklich auf den Marktpreis oder die Liquidität auswirken.

— Fonds — Referenzindex

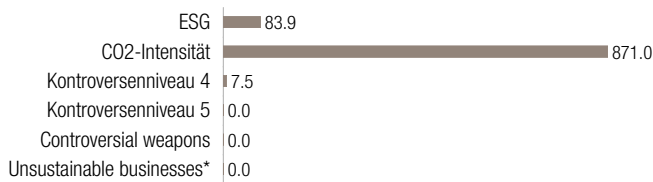
**TOP 10 (IN %)**



**BRANCHEN (IN %)**



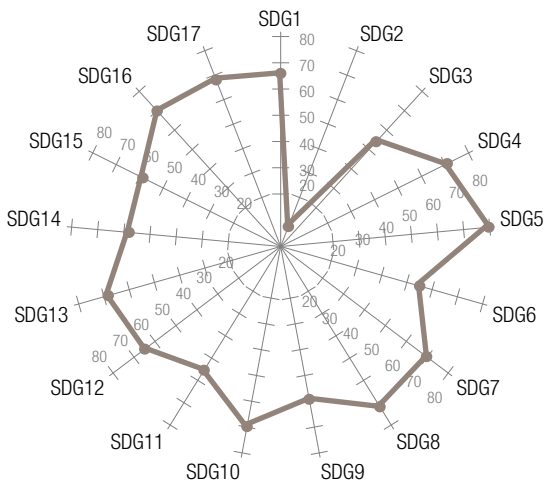
**AUSWIRKUNGEN AUF DIE NACHHALTIGKEIT (IN %)**



**ENGAGEMENT (IN %)**



**SDG exposures**



**GLOSSAR**

**Kreditratings:** Die oben stehende Aufschlüsselung der Kreditratings für Wandelanleihenfonds beruht auf internen Ratings und aus externen Quellen stammenden Ratings.

**Risiko-Ertrags-Profil:** Dieser zusammenfassende Risikoindikator (SRI) ist ein Anhaltspunkt für das Risikoniveau dieses Produkts im Vergleich zu anderen Produkten. Decken die vorliegenden Daten einen Zeitraum von weniger als fünf Jahren ab, werden die fehlenden Erträge anhand einer geeigneten Benchmark simuliert. Der SRI kann sich im Laufe der Zeit ändern und sollte nicht als Indikator für zukünftige Risiken oder Erträge herangezogen werden. Selbst eine Einstufung des Teilfonds in die niedrigste Risikokategorie bedeutet nicht, dass er mit einer risikofreien Anlage gleichgesetzt werden kann oder das Kapital garantiert oder geschützt ist.

**Total Expense Ratio ("TER"):** Die Gesamtgebühren für die Verwaltung und den Betrieb eines Fonds. Die TER umfasst die jährliche Managementgebühr sowie andere Kosten, zum Beispiel Rechts-, Administrations- und Revisionskosten (Quelle: geprüfte Jahresberichte oder ungeprüfte Halbjahresberichte).

**Volatilität:** Eine statistische Messgrösse für die Preisschwankungen eines Wertpapiers. Sie kann auch zur Beschreibung von Wertschwankungen an einem bestimmten Markt verwendet werden. Eine höhere Volatilität deutet auf ein höheres Risiko hin.

**Sharpe Ratio:** Eine Messgrösse für die risikobereinigte Performance. Je grösser diese Verhältniszahl ist, desto besser ist die erzielte risikobereinigte Performance.

**Drawdown:** Der Drawdown wird gewöhnlich als Prozentsatz zwischen dem Höchst- und dem Tiefststand einer Anlage in einem bestimmten Zeitraum ausgedrückt. Er kann beim Vergleich zwischen möglicher Entschädigung und Risiko einer Anlage Anhaltspunkte liefern.

**Korrelation:** Die Korrelation misst, wie sich Wertpapiere oder Anlageklassen gegenüber einander verhalten. Stark korrelierte Anlagen bewegen sich tendenziell im Gleichschritt auf und ab. Anlagen mit einer niedrigen Korrelation hingegen entwickeln sich bei unterschiedlichen Marktverhältnissen eher in entgegengesetzte Richtungen, wodurch Anleger von Diversifikationsvorteilen profitieren. Die Korrelation liegt zwischen 1 (perfekte Korrelation) und -1 (perfekte inverse Korrelation). Ein Korrelationskoeffizient von 0 deutet

auf eine fehlende Wechselwirkung hin.

**Tracking Error:** Ein Mass dafür, wie genau ein Anlageportfolio dem Index folgt, an dem es gemessen wird.

**Bond Floor:** Der niedrigste Wert, auf den Wandelanleihen unter Berücksichtigung des Barwerts der verbleibenden künftigen Cashflows und der Kapitalrückzahlung fallen können. Beim Bond Floor handelt es sich um das Niveau, auf dem eine Wandelanleihe wertlos wird, weil der Kurs der zugrunde liegenden Aktie deutlich unter den Umwandlungswert gesunken ist.

**Delta:** Die Kennzahl, welche die Preisveränderung des zugrunde liegenden Vermögenswerts ins Verhältnis zur entsprechenden Preisveränderung eines Derivats setzt.

**Prämie:** Liegen die aktuellen Zinssätze beim Kauf eines festverzinslichen Wertpapiers (Anleihe) unter dem Couponzins, fällt beim Kauf eine Prämie an. Anleger bezahlen eine Prämie für ein Investment, das mehr einbringt als die aktuellen Zinsen.

**Rendite auf Endverfall:** Die erwartete Verzinsung einer Anleihe, die bis zum Fälligkeitsdatum gehalten wird.

**Coupon:** Die bei der Emission einer Anleihe festgelegte Verzinsung.

**Modified Duration:** Diese Kennzahl drückt aus, wie sich eine Zinsveränderung um 100 Basispunkte (1%) auf den Kurs einer Anleihe auswirkt.

**Durchschnittliche Duration:** Die in Jahren ausgedrückte durchschnittliche Modified Duration eines Portfolios.

**Expected Loss:** Der in Prozent ausgedrückte erwartete durchschnittliche Verlust eines Portfolios pro Jahr.

**Attachment Point:** Die modellierte Wahrscheinlichkeit einer negativen Portfoliorendite in einem bestimmten Jahr.

**Pauschalkommission:** Die Betriebskosten umfassen die Ausgaben, die direkt von der Gesellschaft verursacht werden ("Direktkosten") und jene, die aus den Aktivitäten der Verwaltungsgesellschaft im Auftrag der Gesellschaft entstehen ("Fondsdienstleistungskosten").