

LO Funds (CH) – Swiss Small & Mid Caps Z

Fact Sheet (Marketingmaterial)

Regionale Aktien • Aktien

30. Juni 2024

FONDSDATEN

Fondsdomizil/Rechtsform	Schweiz / FCP
Legal Status	Übrige Anlagefonds für traditionelle Anlagen
Lancierung des Fonds	2. September 1996
Währung des Fonds	CHF
Währung der Klasse	CHF
Fondsmanager	J. Utterman, F. Wiederin
Vermögen (alle Klassen)	CHF 293.42 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 (31. Mai 2024)	0.09%
TER max (31. Januar 2024)	0.08%

RISIKOPROFIL

1	2	3	4	5	6	7
Niedrig						Hoch

CODES

ISIN	CH0137503428
Bloomberg	LOSCSZD SW
Telekurs	13750342
NIW	CHF 887.82

STEUERLICHE INFORMATIONEN

UK - Reporting Status	Nein
DE - Investment-steuergesetz (InvStG)	Equity Fund
Letzte Dividende (10.11.2023)	CHF 18.54

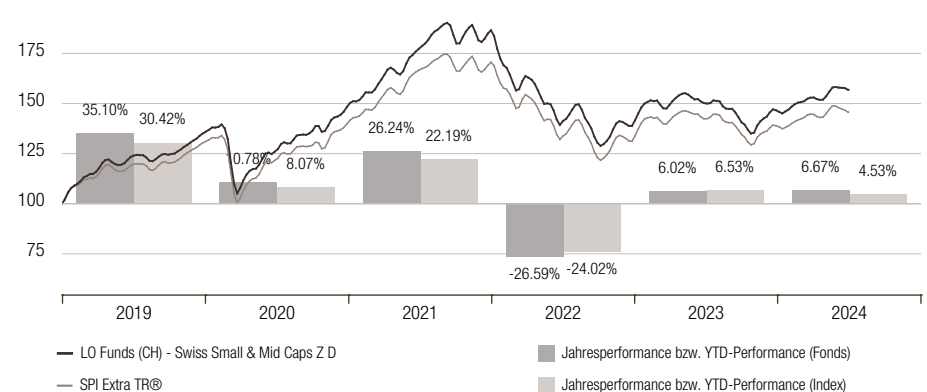
RATINGS

Morningstar Rating	★★★★★
Morningstar Category	EAA Fund Switzerland Small/Mid-Cap Equity

HIGHLIGHTS

LO Funds (CH) - Swiss Small & Mid Caps ist ein aktiv verwaltetes Portfolio. Seine in Schweizer Aktien investierte Long-only-Strategie wird seit September 1996 verfolgt. Das Portfolio investiert hauptsächlich in Schweizer Aktien kleiner und mittlerer Marktkapitalisierung. Es strebt eine langfristige Outperformance des SPI Extra TR® Index an (eingetragenes Markenzeichen der SIX Swiss Exchange AG). Der Anlageansatz folgt dem Bottom-up-Prinzip und basiert auf rigorosen Fundamentalanalysen, mit denen führende Unternehmen mit eindeutigen Wettbewerbsvorteilen, nachweislich erfolgreicher Geschäftsleitung, Kernkompetenzen und überdurchschnittlichem Wachstumspotenzial identifiziert werden sollen. Das Portfolio setzt sich aus rund 35 Positionen zusammen, die eine ausgewogene Mischung aus zyklischen Titeln sowie Wachstums- und Substanzwerten bieten. In Zeiten eines stagnierenden wirtschaftlichen Umfelds kann der Fonds einen bestimmten Anteil seiner Anlagen auf eine größere Kapitalisierung umstellen. Das Risikomanagement führen die Fondsmanager auf Portfolioebene durch, während davon unabhängige Teams die Anlagerisiken und operationellen Risiken überwachen.

KUMULIERTE NETTO / JAHRES-PERFORMANCE IM CHF 31.12.2018 - 30.06.2024



NETTO-PERFORMANCE IN CHF

	Kumulierte		Annualisierte	
	Fonds	Index	Fonds	Index
Seit Anfang Jahr	6.67%	4.53%	-	-
YTD	6.67%	4.53%	-	-
1 Monat	-0.55%	-1.78%	-	-
3 Monate	1.66%	-0.08%	-	-
1 Jahr	3.11%	1.25%	-	-
3 Jahren	-11.49%	-12.37%	-3.97%	-4.29%
5 Jahren	26.32%	21.43%	4.76%	3.94%
10 Jahren	121.80%	93.47%	8.26%	6.80%
Gesamtrendite (seit 02.09.1996)	1'160.84%	923.73%	9.50%	8.69%

STATISTIKEN 30.06.2019 - 30.06.2024

	Fonds	Index
Annualisierte Volat.	15.71%	15.58%
Sharpe Ratio	0.31	0.26
Max. drawdown	-31.43%	-30.06%
Korrelation		0.989
Tracking Error		2.33%

	Fonds
Anzahl der Positionen	40

MONATLICHE RENDITE IN %	2019		2020		2021		2022		2023		2024	
	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index
Januar	9.5	9.2	0.3	0.0	-0.4	0.3	-9.7	-7.5	7.2	7.6	0.4	0.1
Februar	3.4	2.5	-7.9	-7.9	2.2	2.1	-5.0	-4.0	1.8	1.5	0.7	0.7
März	2.2	1.0	-10.5	-11.5	6.8	6.4	0.9	1.2	0.4	0.8	3.7	3.7
April	5.7	6.2	4.8	6.2	1.4	0.8	-3.1	-3.5	1.4	1.2	-1.4	-1.5
Mai	-3.2	-3.9	6.3	6.5	4.2	4.4	-4.8	-3.8	-2.0	-1.6	3.6	3.3
Juni	4.9	4.2	1.4	1.3	3.2	2.9	-7.4	-7.8	0.8	0.4	-0.6	-1.8
Juli	0.2	0.4	1.0	0.6	3.8	2.3	7.4	7.2	0.6	1.4		
August	-1.1	-1.6	5.8	5.6	2.5	2.5	-5.8	-5.4	-2.7	-2.6		
September	1.9	2.2	1.5	0.2	-5.1	-5.0	-8.3	-9.2	-4.6	-4.6		
Oktober	1.2	1.1	-4.1	-4.7	3.1	2.1	3.0	4.1	-5.8	-5.3		
November	4.3	4.5	9.9	10.8	-3.3	-3.3	4.9	4.7	7.2	5.8		
Dezember	2.1	1.9	3.7	3.1	5.8	5.3	-0.9	-1.5	2.6	2.5		
Jahr	35.1	30.4	10.8	8.1	26.2	22.2	-26.6	-24.0	6.0	6.5	6.7	4.5

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

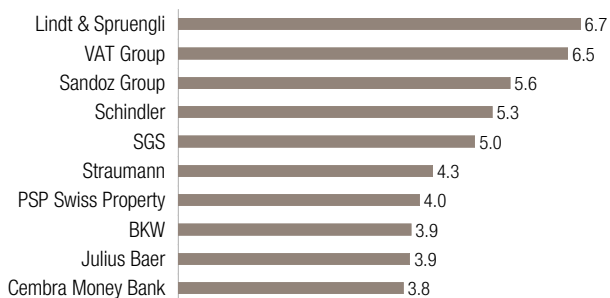
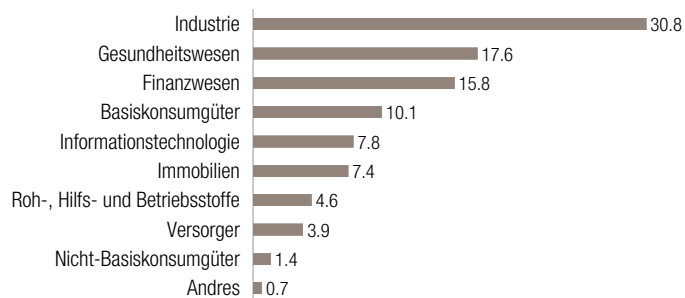
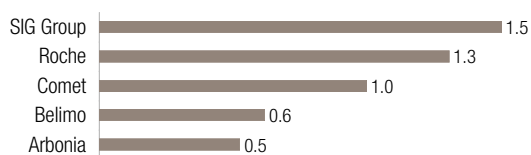
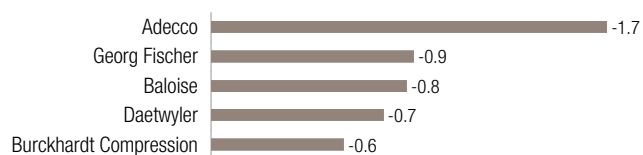
Liquiditätsrisiko: Wenn ein erheblicher Vermögensanteil in Finanzinstrumente angelegt wird, deren Handelbarkeit unter bestimmten Umständen relativ gering ist, besteht ein materielles Risiko, dass der Fonds nicht zu günstigen Zeiten oder Preisen handeln kann. Das kann die Renditen des Fonds schmälern.

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.

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.

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.

TOP 10 (IN %)**BRANCHEN (IN %)****LÄNDER (IN %)****WÄHRUNGEN (IN %)****GEWICHTUNG ERHÖHT****GEWICHTUNG VERMINDERT**

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").