

LO IS (CH) – LPP 30 Z

Fact Sheet (Materiale promozionale)

Risk-Based • Multi-Asset

30 settembre 2024

FUND FACTS

Domicilio/Forma giuridica	Svizzera / FCP
Legal Status	Other investment fund for traditional investments
Data di lancio del fondo	30 agosto 2010
Valuta del Fondo	CHF
Valuta della classe	CHF
Gestore	A. Storno (CFA), A. Forclaz (Ph.D.), F. Ielpo (Ph.D.)
Patrimonio (tutte le classi)	CHF 33.77 milioni
Liquidità (sub./red.)	quotidianamente, 11:00
Investimento minimo	Under IMA
Spesa di sottoscrizione/rimborso	0.00% / 0.00%
Commissione di gestione	0.00%
Commissione di distribuzione	0.00%
Flat fee	0.08%
Ongoing charge (30 agosto 2024)	0.28%
TER max (30 giugno 2023)	0.26%
Comisión de negoc. (sottoscrizione)	0.14%

PROFILO DI RISCHIO

1	2	3	4	5	6	7
Basso						Elevato

CODICI

ISIN	CH0115141985
Bloomberg	LOLPP30 SW
Telekurs	11514198
VNI	CHF 120.29

INFORMAZIONI FISCALI

UK - Reporting Status	No
DE - Investment-steuergesetz (InvStG)	Not Classified
Ultimo dividendo (12.10.2023)	CHF 1.81

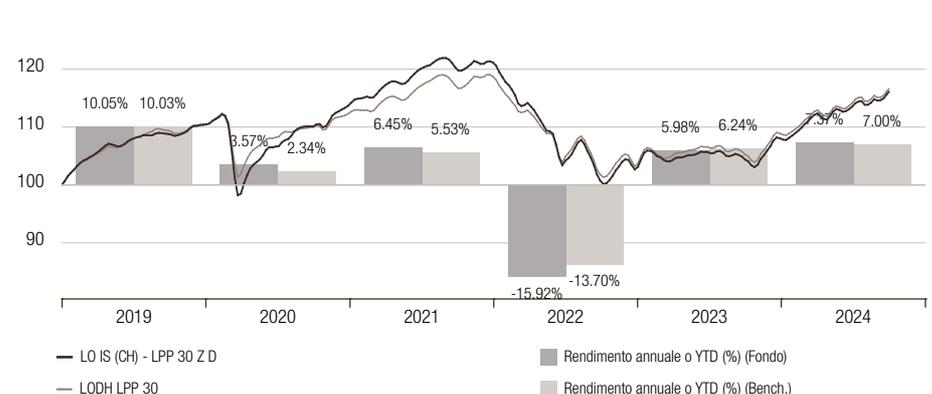
RATINGS

Morningstar Rating	★★★★★
Morningstar Category	CHF Cautious Allocation

EVENTI DI RILIEVO

LO Institutional Strategies (CH) - LPP 30 è una strategia long-only multi-asset che opera da agosto 2010. Investe in diverse classi d'attivo tra cui azioni e titoli del reddito fisso, privilegiando le obbligazioni denominate in CHF. Mira a generare rendimenti stabili nel lungo termine e a superare il LODH LPP 30 Index. Rispetta i principi e i requisiti d'investimento dei fondi pensione svizzeri (LPP/OPP 2). L'approccio d'investimento mira a sfruttare opportunità d'investimento nel mercato obbligazionario svizzero mediante la gestione attiva di obbligazioni denominate in CHF e investimenti in titoli azionari e del reddito fisso internazionali utilizzando la metodologia Smart Beta di LOIM. Tale approccio si propone di offrire rendimenti corretti per il rischio superiori grazie a una maggiore diversificazione rispetto agli indici basati sulla capitalizzazione di mercato. Il portafoglio viene inoltre corretto per tener conto degli indicatori macroeconomici tesi a delineare un quadro dell'attuale contesto economico globale. La gestione del rischio è affidata ai gestori del Fondo a livello di portafoglio e a team indipendenti che supervisionano i rischi d'investimento e operativi.

PERFORMANCE CUMULATIVA NETTO E PERFORMANCE ANNUALE IN CHF 31-dic-2018 - 30-set-2024



PERFORMANCE NETTA IN CHF	Cumulata		Annualizzata	
	Fondo	Bench.	Fondo	Bench.
Da inizio anno	7.37%	7.00%	-	-
YTD	7.37%	7.00%	-	-
1 mese	0.95%	0.87%	-	-
3 mesi	2.27%	2.15%	-	-
1 anno	10.91%	10.43%	-	-
3 anni	-2.96%	-0.02%	-0.99%	-0.01%
5 anni	6.32%	6.28%	1.23%	1.22%
10 anni	27.87%	27.82%	2.48%	2.47%
Rendimento dal lancio (30.08.2010)	50.78%	57.42%	2.95%	3.26%

STATISTICHE 30.09.2019 - 30.09.2024

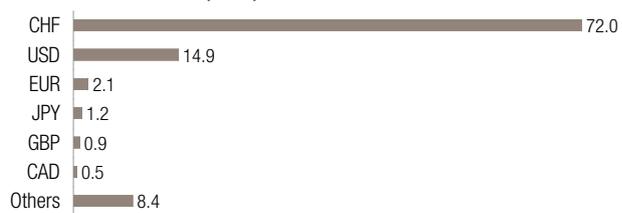
	Fondo	Bench.
Volat. su base annuale	7.63%	6.59%
Indice di Sharpe	0.15	0.17
Max. drawdown	-17.92%	-14.88%
Correlazione		0.981
Tracking Error		1.72%

RENDIMENTI MENSILI

IN %	2019		2020		2021		2022		2023		2024	
	Fondo	Bench.	Fondo	Bench.	Fondo	Bench.	Fondo	Bench.	Fondo	Bench.	Fondo	Bench.
Gennaio	2.8	2.8	0.9	1.1	0.1	-0.4	-2.5	-2.2	3.5	3.4	0.4	0.3
Febbraio	1.4	1.1	-2.1	-1.8	0.0	-0.3	-2.5	-2.3	-1.1	-1.2	1.5	1.4
Marzo	1.3	1.4	-8.4	-5.8	2.6	2.5	-1.1	-1.0	0.2	0.6	2.3	2.2
Aprile	1.8	1.5	4.5	3.5	0.4	0.2	-2.6	-2.1	0.1	0.4	-1.0	-1.2
Maggio	-0.8	-0.5	1.6	1.1	0.6	0.3	-1.6	-1.2	0.5	0.4	0.7	0.9
Giugno	1.2	1.2	0.8	0.5	1.6	1.6	-5.2	-4.1	0.7	0.6	1.0	1.1
Luglio	1.2	1.3	0.8	0.5	0.7	0.8	3.8	3.7	0.2	0.2	1.3	1.3
Agosto	0.4	1.0	2.2	0.6	0.9	0.8	-2.2	-2.1	-0.5	-0.5	0.0	-0.0
Settembre	-0.1	-0.4	0.2	0.4	-1.9	-2.0	-4.7	-4.3	-1.0	-1.0	1.0	0.9
Ottobre	-0.3	-0.5	-0.9	-1.3	0.4	0.5	2.2	2.2	-1.7	-1.7		
Novembre	1.5	1.5	3.3	3.0	0.1	0.7	2.3	2.0	3.0	2.8		
Dicembre	-0.4	-0.6	1.2	0.8	1.0	0.7	-2.6	-2.9	2.0	2.0		
Anno	10.0	10.0	3.6	2.3	6.5	5.5	-15.9	-13.7	6.0	6.2	7.4	7.0

Prima di prendere qualsiasi decisione d'investimento, si prega di consultare l'ultima versione del Prospetto, lo Statuto, i Documenti contenenti informazioni (KID) e l'ultima versione delle relazioni annuali e semestrali. Si invita a prestare attenzione all'Appendice B "Allegato fattori di rischio" del Prospetto.

L'integrazione di rischi extra-finanziari nel processo decisionale relativo agli investimenti può comportare la sottoponderazione di investimenti redditizi nell'universo di investimento del comparto e può anche indurre i gestori del comparto a sottoponderare investimenti che continueranno a essere performanti. I rischi di sostenibilità possono causare un notevole peggioramento del profilo finanziario, della redditività o della reputazione di un investimento sottostante e possono pertanto avere un impatto significativo sul suo prezzo di mercato o sulla sua liquidità.

SCOMPOSIZIONE VALUTARIA (IN %)**ATTIVI (IN %)**