

LO IS (CH) – LPP 30 I

Fact Sheet (Marketingmaterial)

Risk-Based • Multi-Asset

31. Oktober 2024

FONDSDATEN

Fondsdomizil/Rechtsform	Schweiz / FCP
Legal Status	Übrige Anlagefonds für traditionelle Anlagen
Lancierung des Fonds	30. August 2010
Währung des Fonds	CHF
Währung der Klasse	CHF
Fondsmanager	A. Storno (CFA), A. Forclaz (Ph.D.), F. Ielpo (Ph.D.)
Vermögen (alle Klassen)	CHF 42.84 Millionen
Liquidität (Zeich./Rück.)	täglich, 11:00
Ausgabe / Rücknahmeaufschläge	0.00% / 0.00%
Verwaltungskommission	0.35%
Vertriebsgebühr	0.00%
Pauschalkommission	0.10%
Performance-Fee	15% der Outperformance des Fonds
Ongoing charge (30. September 2024)	0.66%
TER max (30. Juni 2023)	0.63%
Transaktionsgebühr (Zeichnung)	0.14%

RISIKOPROFIL

1	2	3	4	5	6	7
Niedrig			Hoch			

CODES

ISIN	CH0115141670
Bloomberg	LPP30ID SW
Telekurs	11514167
NIW	CHF 116.07

STEUERLICHE INFORMATIONEN

UK - Reporting Status	Nein
DE - Investment-steuergesetz (InvStG)	Not Classified
Letzte Dividende (10.10.2024)	CHF 1.59

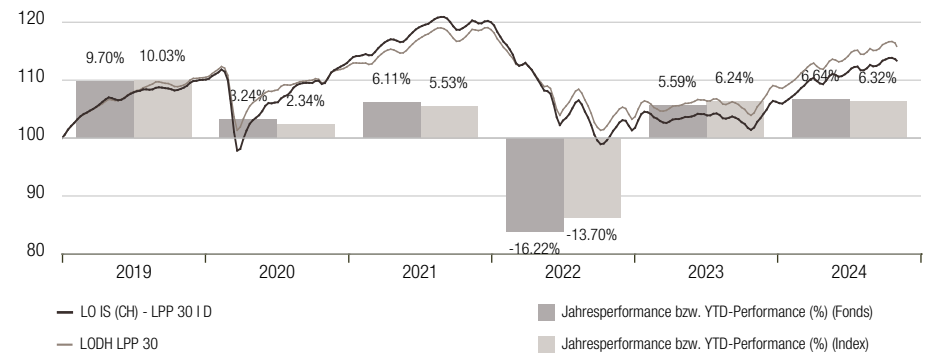
RATINGS

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

HIGHLIGHTS

LO Institutional Strategies (CH) - LPP 30 ist eine Long-only-Multi-Asset-Strategie, die seit August 2010 verfolgt wird. Der Fonds investiert in verschiedene Anlageklassen, darunter Aktien und festverzinsliche Wertpapiere, mit einem Schwerpunkt auf CHF-Anleihen. Er verfolgt das Ziel, langfristig stabile Renditen zu erwirtschaften und den LODH LPP 30 Index zu übertreffen. Der Fonds befolgt die für Schweizer Pensionskassen geltenden Grundsätze und Anlagebestimmungen (BVG/BV 2). Durch das aktive Management von CHF-Anleihen und die Allokation in internationalen Aktien und festverzinslichen Wertpapieren mithilfe des LOIM-Smart-Beta-Ansatzes strebt der Anlageansatz an, von Anlagechancen am Schweizer Anleihenmarkt zu profitieren. Dieser Ansatz zielt darauf ab, durch bessere Diversifizierung höhere risikobereinigte Renditen zu erzielen als Marktkapitalisierungsindizes. Auf der Basis von makroökonomischen Indikatoren, die eine Einschätzung des aktuellen globalen Konjunkturmilieus erlauben sollen, wird das Portfolio weiter angepasst. Das Risikomanagement erfolgt durch Fondsmanager auf Portfolioebene. Unabhängige Teams überwachen die Anlage- und operationellen Risiken.

KUMULIERTE NETTO / JAHRES-PERFORMANCE IM CHF 31.12.2018 - 31.10.2024



NETTO-PERFORMANCE IN CHF

	Kumulierte	
	Fonds	Index
Seit Anfang Jahr	6.64%	6.32%
YTD	7.07%	7.00%
1 Monat	-0.41%	-0.64%
3 Monate	0.53%	0.20%
1 Jahr	11.94%	11.57%
3 Jahren	-4.74%	-1.15%
5 Jahren	4.38%	6.17%
10 Jahren	22.80%	26.45%
Gesamtrendite (seit 01.11.2013)	29.62%	34.97%

Annualisierte

	Fonds	Index
Seit Anfang Jahr	-	-
YTD	-	-
1 Monat	-	-
3 Monate	-	-
1 Jahr	-	-
3 Jahren	-1.60%	-0.38%
5 Jahren	0.86%	1.20%
10 Jahren	2.07%	2.37%
Gesamtrendite (seit 01.11.2013)	2.38%	2.75%

STATISTIKEN 31.10.2019 - 31.10.2024

	Fonds	Index
Annualisierte Volat.	7.63%	6.59%
Sharpe Ratio	0.10	0.16
Max. drawdown	-18.22%	-14.88%
Korrelation		0.981
Tracking Error		1.72%

MONATLICHE RENDITE IN %	2019		2020		2021		2022		2023		2024	
	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index	Fonds	Index
Januar	2.7	2.8	0.8	1.1	0.1	-0.4	-2.5	-2.2	3.5	3.4	0.4	0.3
Februar	1.3	1.1	-2.1	-1.8	-0.0	-0.3	-2.6	-2.3	-1.1	-1.2	1.5	1.4
März	1.2	1.4	-8.4	-5.8	2.5	2.5	-1.2	-1.0	0.1	0.6	2.3	2.2
April	1.7	1.5	4.5	3.5	0.4	0.2	-2.6	-2.1	0.1	0.4	-1.0	-1.2
Mai	-0.9	-0.5	1.5	1.1	0.5	0.3	-1.7	-1.2	0.5	0.4	0.6	0.9
Juni	1.2	1.2	0.7	0.5	1.6	1.6	-5.3	-4.1	0.6	0.6	1.0	1.1
Juli	1.1	1.3	0.8	0.5	0.7	0.8	3.7	3.7	0.2	0.2	1.2	1.3
August	0.3	1.0	2.1	0.6	0.9	0.8	-2.2	-2.1	-0.5	-0.5	0.0	-0.0
September	-0.2	-0.4	0.2	0.4	-2.0	-2.0	-4.7	-4.3	-1.0	-1.0	0.9	0.9
Oktober	-0.3	-0.5	-0.9	-1.3	0.4	0.5	2.2	2.2	-1.7	-1.7	-0.4	-0.6
November	1.5	1.5	3.3	3.0	0.0	0.7	2.3	2.0	3.0	2.8		
Dezember	-0.5	-0.6	1.2	0.8	0.9	0.7	-2.6	-2.9	2.0	2.0		
Jahr	9.7	10.0	3.2	2.3	6.1	5.5	-16.2	-13.7	5.6	6.2	6.6	6.3

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.

WÄHRUNGEN (IN %)**ANLAGEKATEGORIEN (IN %)**