

# AKTIEN GLOBAL LOW VOL (AGHD)

## Eckdaten

|                     |                                  |
|---------------------|----------------------------------|
| Depotbank           | Bank Lombard Odier & Co AG       |
| Lancierung          | Januar 2012                      |
| Währung             | CHF                              |
| Zeichnung/Rücknahme | täglich bis 14 Uhr (T)           |
| Ende Geschäftsjahr  | 30. September                    |
| Ausschüttung        | thesaurierend                    |
| Benchmark 1         | MSCI World ex-CH ndr             |
| Benchmark 2         | S&P Dev. High Income NTR         |
| Fondsvermögen       | CHF 43.89 Mio.                   |
| Basisportfolio      | CHF 86.00 Mio.                   |
| Anzahl Positionen   | 190                              |
| Kursquelle          | Bloomberg ISTAGHD<br>istfunds.ch |
| NAV Kategorie I     | CHF 1'745.38                     |
| NAV Kategorie II    | CHF 1'758.28                     |
| NAV Kategorie III   | CHF 1'764.90                     |

## Fondsmanager

|                      |                                       |
|----------------------|---------------------------------------|
| Fondsmanager         | Robeco Institutional Asset Management |
| Fondsmanager seit    | September 2015                        |
| Unterzeichnung UNPRI | ja                                    |

## Zeichnung / Rücknahme

|                  |            |
|------------------|------------|
| Valuta Zeichnung | T + 2 Tage |
| Valuta Rücknahme | T + 2 Tage |

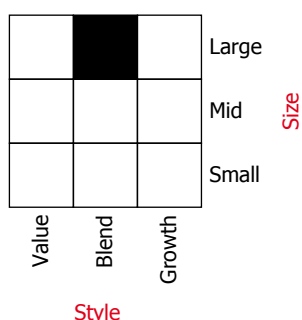
## Kennzahlen

|                        |        |
|------------------------|--------|
| Tracking Error ex-post | 4.68 % |
| Beta                   | 0.75   |
| Dividendenrendite      | 3.37 % |

## ESG

|                     |    |
|---------------------|----|
| Stimmrechtsausübung | Ja |
| Ausschlussliste     | Ja |

## Morningstar Style-Box™, 1



Quelle: Copyright ©2017 Morningstar UK Ltd.

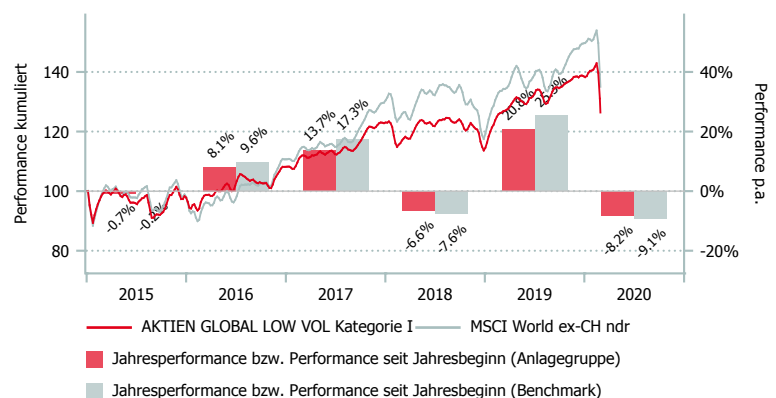
## Anlagepolitik

IST AKTIEN GLOBAL LOW VOL ist eine aktiv verwaltete Anlagegruppe, welche mit einem quant-basierten Anlageansatz weltweit in Aktien investiert. Die zu Grunde liegende Strategie basiert auf einem robusten, proprietären Titelselektionsmodell des Portfolio Managers mit Fokus auf tiefem Risiko, Momentum und überdurchschnittlicher Dividendenrendite. Investitionen erfolgen mit mittel- bis langfristigem Horizont in qualitativ hochwertige, attraktiv bewertete Unternehmen. Ziel ist, die Performance des Referenzindex MSCI Welt ex Switzerland über einen Investitionszyklus hinweg bei geringerer Volatilität zu übertreffen. Der aktive Ansatz führt zu einem Tracking Error von rund 3–6%. Die Dividendenrendite liegt anlageansatzbedingt deutlich über derjenigen der Benchmark während das Beta unter 1 liegt.

Die ESG-Kriterien des Schweizer Vereins für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK-ASIR) werden angewendet. Unternehmen, die auf der Ausschlussliste des SVVK-ASIR figurieren, werden nicht ins Portfolio aufgenommen.

Seit Januar 2020 werden die Aktionärsstimmrechte aktiv wahrgenommen, basierend auf Empfehlungen von Corporate Governance Spezialisten.

## Performance in CHF (in %, netto nach Kosten)



|               | 1 Mt. | 3 Mt.  | 6 Mt. | 1 J.  | 3 J.* | 5 J.* | Vol. 3 J. |
|---------------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| AGHD Kat. I   | -8.61 | -9.43  | -4.81 | 0.39  | 4.42  | 5.07  | 10.11     |
| AGHD Kat. II  | -8.60 | -9.42  | -4.76 | 0.48  | 4.52  | 5.18  | 10.11     |
| AGHD Kat. III | -8.60 | -9.40  | -4.74 | 0.53  | 4.57  | 5.23  | 10.11     |
| BM 1          | -8.14 | -9.33  | -1.30 | 1.48  | 5.97  | 6.38  | 12.67     |
| BM 2          | -9.15 | -12.54 | -4.18 | -6.58 | 0.13  | 2.87  | 12.56     |

\*annualisiert

|               | 2014  | 2015  | 2016  | 2017  | 2018   | 2019  | YTD    |
|---------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|--------|
| AGHD Kat. I   | 9.47  | -0.75 | 8.13  | 13.71 | -6.60  | 20.80 | -8.21  |
| AGHD Kat. II  | 9.58  | -0.65 | 8.24  | 13.83 | -6.50  | 20.92 | -8.20  |
| AGHD Kat. III | 9.64  | -0.60 | 8.29  | 13.88 | -6.46  | 20.98 | -8.19  |
| BM 1          | 17.46 | -0.18 | 9.63  | 17.34 | -7.64  | 25.27 | -9.11  |
| BM 2          | 12.12 | -3.27 | 14.82 | 12.07 | -11.49 | 17.98 | -12.86 |

## Aufteilung des Portfolios (in %)

### Top 10 (in %)

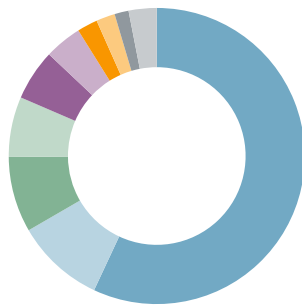
|                        | AGHD | BM 1 |
|------------------------|------|------|
| JP Morgan Chase        | 1.5  | 0.9  |
| Intel Corp             | 1.4  | 0.6  |
| Procter & Gamble       | 1.3  | 0.7  |
| Home Depot             | 1.3  | 0.6  |
| Verizon Communications | 1.1  | 0.6  |
| Coca-Cola Co.          | 1.1  | 0.6  |
| Pepsico                | 1.1  | 0.5  |
| Mc Donald's            | 1.0  | 0.4  |
| Merck & Co             | 1.0  | 0.5  |
| AT&T Inc               | 1.0  | 0.7  |

### Branchen (in %)

|                               | AGHD | BM 1 |
|-------------------------------|------|------|
| Finanzwesen                   | 20.0 | 15.2 |
| Nicht-Basiskonsumgüter        | 13.6 | 10.6 |
| Versorger                     | 13.0 | 3.8  |
| Industrie                     | 9.9  | 10.9 |
| IT-Dienstleistungen           | 9.4  | 18.9 |
| Telekomdienstleistungen       | 8.7  | 8.9  |
| Basiskonsumgüter              | 8.7  | 7.8  |
| Immobilien                    | 7.0  | 3.3  |
| Gesundheitswesen              | 6.5  | 12.3 |
| Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 2.8  | 4.1  |
| Energie                       | 0.4  | 4.3  |

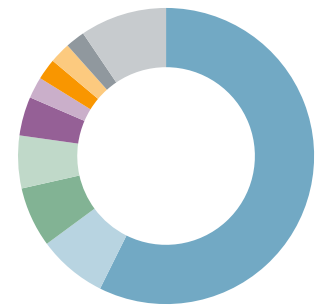
### Währungen (in %)

|        | AGHD | BM 1 |
|--------|------|------|
| USD    | 57.0 | 65.9 |
| EUR    | 9.7  | 11.4 |
| CAD    | 8.3  | 3.4  |
| AUD    | 6.6  | 2.3  |
| JPY    | 5.6  | 8.3  |
| GBP    | 4.1  | 5.0  |
| HKD    | 2.2  | 1.1  |
| NOK    | 2.1  | 0.2  |
| SGD    | 1.5  | 0.5  |
| Übrige | 3.1  | 1.8  |



### Länder (in %)

|                 | AGHD | BM 1 |
|-----------------|------|------|
| USA             | 57.4 | 65.8 |
| Kanada          | 7.5  | 3.5  |
| Australien      | 6.6  | 2.3  |
| Japan           | 5.8  | 8.3  |
| Grossbritannien | 4.2  | 5.0  |
| Deutschland     | 2.3  | 2.9  |
| Hongkong        | 2.3  | 1.2  |
| Italien         | 2.3  | 0.8  |
| Norwegen        | 2.1  | 0.2  |
| Übrige          | 9.5  | 9.9  |



## Kategorienübersicht

|   | Kategorie I  | Kategorie II | Kategorie III |
|---|--------------|--------------|---------------|
| Valor   | 14.316.840   | 14.316.842   | 14.316.843    |
| ISIN  | CH0143168406 | CH0143168422 | CH0143168430  |
| Investitionsgrösse in CHF                                 | < 10 Mio.    | 10 - 30 Mio. | > 30 Mio.     |
| TER KGAST <sup>2</sup> in % p.a. per 30.09.2019           | 0.67         | 0.57         | 0.52          |
| davon TER Zielfonds <sup>3</sup> in % p.a. per 30.09.2019 | 0.45         | 0.45         | 0.45          |
| ex-ante TER <sup>4</sup> in % p.a. per 30.11.2019         | 0.65         | -            | -             |
| Gebühren Kauf / Verkauf in % <sup>5</sup>                 | 0.10         | 0.10         | 0.10          |

<sup>1</sup> Die Morningstar Style Box™ zeigt die Anlagestrategie eines Fonds an. Für mehr Informationen, besuchen Sie unsere Website [www.morningstar.com](http://www.morningstar.com).

<sup>2</sup> Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

<sup>3</sup> Die TER Zielfonds entsprechen den gewichteten TER der unterliegenden Publikumfonds respektive der institutionellen Fonds der IST. Die Angabe entspricht der Höhe des zuletzt berechneten TER und bietet keine Gewähr für eine entsprechende Höhe in der Zukunft.

<sup>4</sup> Die Total Expense Ratio ex ante (TER ex ante) antizipiert alle Kosten, die im Durchschnitt der nächsten 12 Monate bei gleich bleibenden Voraussetzungen dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand).

<sup>5</sup> zu Gunsten der Anlagegruppe

Datenquelle Benchmark: MSCI/S&P