

AKTIEN SCHWEIZ MINIMUM VARIANZ (ASMV)

Eckdaten

| | |
|---------------------|----------------------------|
| Depotbank | Bank Lombard Odier & Co AG |
| Lancierung | Oktober 2013 |
| Währung | CHF |
| Zeichnung/Rücknahme | täglich bis 14 Uhr (T) |
| Ende Geschäftsjahr | 30. September |
| Ausschüttung | thesaurierend |
| Benchmark | SPI |
| Fondsvermögen | CHF 77.08 Mio. |
| Anzahl Positionen | 35 |
| NAV Kategorie II | CHF 1'982.12 |
| NAV Kategorie III | CHF 1'987.45 |

Fondsmanager

| | |
|----------------------|--------------|
| Fondsmanager | Unigestion |
| Fondsmanager seit | Oktober 2013 |
| Unterzeichnung UNPRI | ja |

Zeichnung / Rücknahme

| | |
|------------------|------------|
| Valuta Zeichnung | T + 3 Tage |
| Valuta Rücknahme | T + 3 Tage |

Kennzahlen

| | |
|------------------------|-------|
| Tracking Error ex-post | 2.40% |
| Beta | 0.94 |

ESG

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

Morningstar Style-Box™, 1

| | | | |
|-------|-------|--------|-------|
| | | | Large |
| | | | Mid |
| | | | Small |
| Value | Blend | Growth | Size |
| | | | Style |

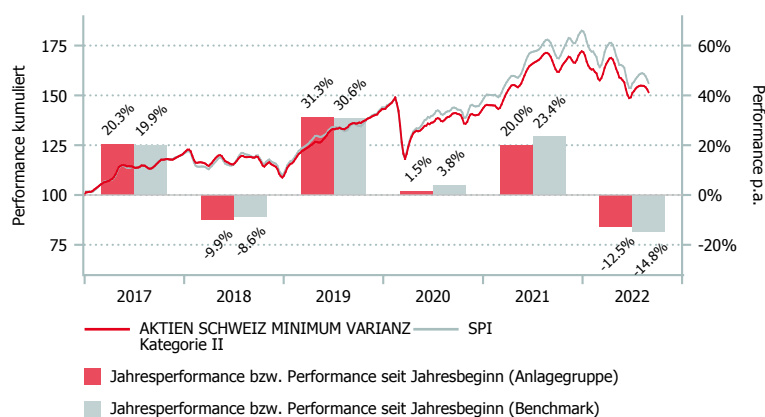
Quelle: Morningstar

Anlagepolitik

AKTIEN SCHWEIZ MINIMUM VARIANZ ist eine aktiv verwaltete Anlagegruppe für Schweizer Aktien. Als Basis dienen die Titel des Swiss Performance Indexes, wobei in einem ersten Schritt illiquide und Titel mit instabilen Risikoprofil ausgesondert werden. Unter Verwendung eines proprietären Quant Modells wird im zweiten Schritt das Portfolio mit dem Ziel des minimalen Risikos konstruiert. Eine auf fundamentalem Research basierende Prüfung bildet den dritten Schritt in der Portfoliokonstruktion. Das Portfolio besteht in der Regel aus 35 – 50 Positionen. Die Gewichtung einer Position darf maximal 5% über der Gewichtung des entsprechenden Titels im Swiss Performance Index (SPI) liegen. Ziel der Anlagegruppe ist, im mittel- bis längerfristigen Horizont die Indexperformance bei vergleichsweise tieferer Volatilität des Portfolios zu übertreffen.

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. Von der Anlage ebenfalls ausgeschlossen sind Unternehmen (Bergbauunternehmen oder Stromerzeuger), die mehr als 25% ihres Umsatzes aus thermischer Kohle erzeugen, basierend auf den Klassifizierungen von Sustainalytics. Die Aktionärsstimmrechte werden aktiv wahrgenommen, basierend auf Empfehlungen eines Corporate Governance Spezialisten. Seit Januar 2020 werden die Aktionärsstimmrechte aktiv durch den mandatierten Manager wahrgenommen, basierend auf Empfehlungen von Corporate Governance Spezialisten. Weitere Informationen siehe ESG-Factsheet unter istfunds.ch/produkte-kurse.

Performance in CHF (in %, netto nach Kosten)



| | 1 Mt. | 3 Mt. | 6 Mt. | 1 J. | 3 J.* | 5 J.* | Vol. 3 J. |
|---------------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-----------|
| ASMV Kat. II | -2.10 | -4.42 | -6.14 | -11.19 | 3.87 | 6.00 | 13.09 |
| ASMV Kat. III | -2.10 | -4.41 | -6.12 | -11.16 | 3.91 | 6.05 | 13.09 |
| BM | -3.06 | -6.14 | -7.70 | -12.19 | 5.10 | 6.59 | 13.73 |

*annualisiert

| | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | YTD |
|---------------|-------|-------|-------|-------|------|-------|--------|
| ASMV Kat. II | 4.56 | 20.31 | -9.90 | 31.26 | 1.49 | 19.98 | -12.50 |
| ASMV Kat. III | 4.57 | 20.37 | -9.86 | 31.32 | 1.54 | 20.03 | -12.47 |
| BM | -1.41 | 19.92 | -8.57 | 30.59 | 3.82 | 23.38 | -14.84 |

AKTIEN SCHWEIZ MINIMUM VARIANZ (ASMV)

Aufteilung des Portfolios (in %)

Top 10 (in %)

| | ASMV | BM |
|--------------------------|------|------|
| Nestlé (N) | 18.0 | 21.2 |
| Roche (GS) | 13.7 | 14.6 |
| Novartis (N) | 12.0 | 12.5 |
| Zurich Insurance Grp (N) | 4.8 | 4.3 |
| Swiss Re AG (N) | 4.1 | 1.5 |
| Swisscom (N) | 3.6 | 0.9 |
| Swiss Prime Site (N) | 3.3 | 0.4 |
| Swatch Group (I) | 3.2 | 0.5 |
| Tecan Group (N) | 3.2 | 0.3 |
| Psp Swiss Property (N) | 3.2 | 0.3 |

Branchen (in %)

| | ASMV | BM |
|-------------------------------|------|------|
| Gesundheitswesen | 30.0 | 35.7 |
| Basiskonsumgüter | 21.2 | 23.5 |
| Finanzwesen | 14.3 | 15.3 |
| Industrie | 8.0 | 9.7 |
| Immobilien | 7.2 | 1.4 |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 5.5 | 4.9 |
| IT-Dienstleistungen | 4.1 | 1.7 |
| Telekomdienstleistungen | 3.6 | 0.9 |
| Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 1.6 | 6.7 |
| Versorger | 0.0 | 0.2 |
| Sonstige (inkl. Liq.) | 4.6 | 0.0 |

Kategorienübersicht

| | Kategorie II | Kategorie III |
|---|--------------|---------------|
| Valor | 34.706.367 | 22.431.333 |
| ISIN | CH0347063676 | CH0224313335 |
| Investitionsgrösse in CHF | - | > 30 Mio. |
| TER KGAST ² in % p.a. per 30.09.2021 | 0.50 | 0.46 |
| davon TER Zielfonds ³ in % p.a. per 30.09.2021 | 0.38 | 0.38 |
| Gebühren Kauf / Verkauf in % ⁴ | 0.10 | 0.10 |

¹ Die Morningstar Style Box™ zeigt die Anlagestrategie eines Fonds an. Informationen unter www.morningstar.com.

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

³ Die TER Zielfonds entsprechen den gewichteten TER der unterliegenden Publikumsfonds 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.

⁴ zu Gunsten der Anlagegruppe

Datenquelle Benchmark: SIX Swiss Exchange