

# 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 68.02 Mio.
Basisportfolio	CHF 73.09 Mio.
Anzahl Positionen	37
NAV Kategorie II	CHF 1'940.50
NAV Kategorie III	CHF 1'946.62

## Fondsmanager

Fondsmanager	Unigestion
Fondsmanager seit	Oktober 2013
Unterzeichnung UNPRI	ja

## Zeichnung / Rücknahme

Valuta Zeichnung	T + 3 Tage
Valuta Rücknahme	T + 3 Tage

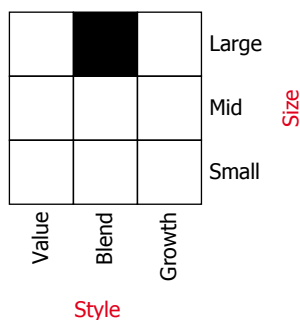
## Kennzahlen

Tracking Error ex-post	3.12%
Beta	0.88

## ESG

Stimmrechtsausübung	Ja
Ausschlussliste	Ja

## Morningstar Style-Box™, 1



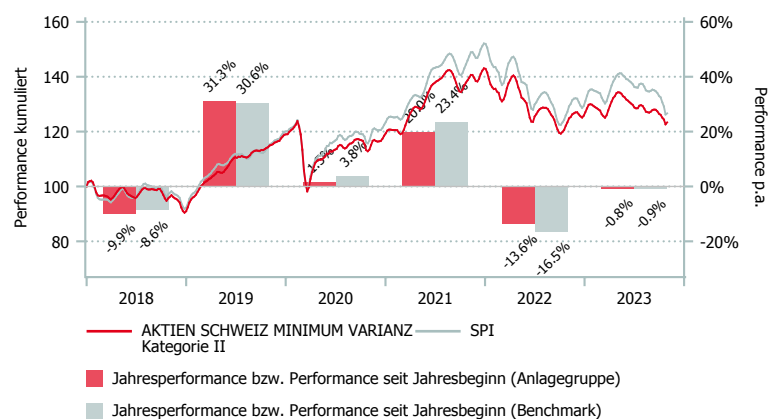
Quelle: Morningstar

## 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](http://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	-2.81	-5.33	-8.02	-0.88	4.16	4.85	12.29
ASMV Kat. III	-2.81	-5.32	-8.00	-0.84	4.20	4.90	12.29
BM	-5.24	-8.78	-9.66	-1.35	4.32	5.07	13.72

\*annualisiert

	2017	2018	2019	2020	2021	2022	YTD
ASMV Kat. II	20.31	-9.90	31.26	1.49	19.98	-13.64	-0.81
ASMV Kat. III	20.37	-9.86	31.32	1.54	20.03	-13.60	-0.78
BM	19.92	-8.57	30.59	3.82	23.38	-16.48	-0.86

## AKTIEN SCHWEIZ MINIMUM VARIANZ (ASMV)

### Aufteilung des Portfolios (in %)

#### Top 10 (in %)

	ASMV	BM
Nestlé (N)	15.7	18.9
Novartis (N)	12.5	12.9
Roche (GS)	11.5	11.9
Zurich Insurance Grp (N)	7.7	4.5
UBS Group (N)	4.5	4.7
Swisscom (N)	4.1	1.0
Bcv (N)	3.5	0.2
Baloise Holding (N)	3.5	0.4
Galenica Santé (N)	3.3	0.3
Swiss Re AG (N)	3.3	2.1

#### Branchen (in %)

	ASMV	BM
Finanzwesen	32.4	17.4
Gesundheitswesen	28.5	33.2
Basiskonsumgüter	17.6	21.1
Immobilien	8.0	1.4
Industrie	5.3	11.0
Telekomdienstleistungen	4.1	1.0
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	2.0	7.4
Nicht-Basiskonsumgüter	1.1	5.1
IT-Dienstleistungen	0.5	2.1
Versorger	0.0	0.3
Sonstige (inkl. Liq.)	0.6	0.0

### Kategorienübersicht

	Kategorie II	Kategorie III
Valor	34.706.367	22.431.333
ISIN	CH0347063676	CH0224313335
Investitionsgrösse in CHF	-	> 30 Mio.
TER KGAST <sup>2</sup> in % p.a. per 30.09.2023	0.52	0.48
davon TER Zielfonds <sup>3</sup> in % p.a. per 30.09.2023	0.42	0.42
Gebühren Kauf / Verkauf in % <sup>4</sup>	0.10	0.10

<sup>1</sup> Die Morningstar Style Box™ zeigt die Anlagestrategie eines Fonds an. Informationen unter [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> zu Gunsten der Anlagegruppe

Datenquelle Benchmark: SIX Swiss Exchange