

## AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS (ASPI)

### Eckdaten

|                     |                                  |
|---------------------|----------------------------------|
| Depotbank           | Bank Lombard Odier & Co AG       |
| Lancierung          | Januar 2007                      |
| Währung             | CHF                              |
| Zeichnung/Rücknahme | täglich bis 14 Uhr (T)           |
| Ende Geschäftsjahr  | 30. September                    |
| Ausschüttung        | thesaurierend                    |
| Benchmark           | SPI                              |
| Fondsvermögen       | CHF 58.20 Mio.                   |
| Basisportfolio      | CHF 142.04 Mio.                  |
| Anzahl Positionen   | 75                               |
| Kursquelle          | Bloomberg ISTASPL<br>istfunds.ch |
| NAV Kategorie I     | CHF 2'359.77                     |
| NAV Kategorie II    | CHF 2'373.76                     |
| NAV Kategorie III   | CHF 2'437.68                     |

### Fondsmanager

|                   |               |
|-------------------|---------------|
| Fondsmanager      | Swiss Rock AM |
| Fondsmanager seit | März 2013     |

### Zeichnung / Rücknahme

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

### Kennzahlen

|                        |       |
|------------------------|-------|
| Tracking Error ex-post | 1.20% |
| Beta                   | 0.95  |

### ESG

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

### Style Box<sup>1</sup>

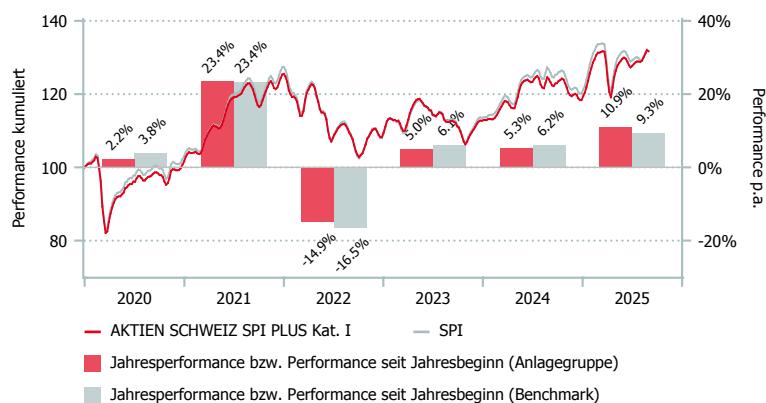
|          |       |          |        |
|----------|-------|----------|--------|
|          |       |          | Gross  |
|          |       |          | Mittel |
|          |       |          | Klein  |
| Substanz | Blend | Wachstum | Size   |
|          |       |          | Style  |

### Anlagepolitik

AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS ist eine aktiv, nach einem quantitativen Modellansatz bewirtschaftete Anlagegruppe. Die Titel des Swiss Performance Indexes (SPI) bilden das Universum. Der Fokus des eingesetzten Titelselektionsmodells liegt auf den Aspekten Profitabilität (z.B. ROE, Cashflow), Momentum (z.B. Revision von Gewinnschätzungen, Sentiment) und Bewertung (z.B. Dividendenrendite, EBITDA/EV). Das Portfolio weist typischerweise ca. 60 Positionen auf, deren Gewichtung maximal 2% von der Gewichtung des Titels im SPI abweichen darf. Der angestrebte ex-ante Tracking Error beträgt max. 1.5%.

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. 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. |
|---------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-----------|
| ASPI Kat. I   | 2.54  | 1.85  | 0.26  | 4.64 | 6.56  | 6.32  | 10.54     |
| ASPI Kat. II  | 2.54  | 1.86  | 0.29  | 4.71 | 6.63  | 6.38  | 10.54     |
| ASPI Kat. III | 2.55  | 1.87  | 0.31  | 4.75 | 6.67  | 6.42  | 10.54     |
| BM            | 2.31  | 0.34  | -1.41 | 2.45 | 6.48  | 5.96  | 11.09     |

\*annualisiert

|               | 2019  | 2020 | 2021  | 2022   | 2023 | 2024 | YTD   |
|---------------|-------|------|-------|--------|------|------|-------|
| ASPI Kat. I   | 29.77 | 2.19 | 23.44 | -14.89 | 5.02 | 5.31 | 10.93 |
| ASPI Kat. II  | 29.87 | 2.25 | 23.51 | -14.84 | 5.08 | 5.38 | 10.97 |
| ASPI Kat. III | 29.92 | 2.30 | 23.56 | -14.80 | 5.12 | 5.42 | 11.00 |
| BM            | 30.59 | 3.82 | 23.38 | -16.48 | 6.09 | 6.18 | 9.28  |

## Aufteilung des Portfolios (in %)

## Top 10 (in %)

|                          | ASPI | BM   |
|--------------------------|------|------|
| Novartis (N)             | 13.0 | 12.3 |
| Nestlé (N)               | 11.9 | 12.0 |
| Roche (GS)               | 10.5 | 11.3 |
| UBS Group (N)            | 6.7  | 6.0  |
| Zurich Insurance Grp (N) | 6.0  | 5.3  |
| ABB Ltd (N)              | 5.4  | 5.2  |
| Cie Fin. Richemont (N)   | 3.8  | 4.7  |
| Swiss Re AG (N)          | 3.3  | 2.6  |
| Holcim (N)               | 3.0  | 2.2  |
| Geberit (N)              | 1.9  | 1.2  |

## Branchen (in %)

|                               | ASPI | BM   |
|-------------------------------|------|------|
| Gesundheitswesen              | 30.2 | 33.8 |
| Finanzwesen                   | 21.9 | 20.8 |
| Industrie                     | 18.1 | 13.2 |
| Basiskonsumgüter              | 14.3 | 14.1 |
| Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 5.9  | 7.9  |
| Nicht-Basiskonsumgüter        | 4.7  | 5.4  |
| IT-Dienstleistungen           | 3.2  | 1.8  |
| Versorger                     | 1.8  | 0.2  |
| Telekomdienstleistungen       | 0.6  | 1.2  |
| Immobilien                    | 0.1  | 1.6  |
| Sonstige (inkl. Liq.)         | -0.6 | 0.0  |

## Kategorienübersicht

|                                                           | Kat. I       | Kat. II      | Kat. III     |
|-----------------------------------------------------------|--------------|--------------|--------------|
| Valor                                                     | 2.733.872    | 2.903.078    | 2.903.079    |
| ISIN                                                      | CH0027338729 | CH0029030787 | CH0029030795 |
| Investitionsgrösse in CHF                                 | < 10 Mio.    | 10 - 30 Mio. | > 30 Mio.    |
| TER KGAST <sup>2</sup> in % p.a. per 30.09.2024           | 0.31         | 0.25         | 0.21         |
| davon TER Zielfonds <sup>3</sup> in % p.a. per 30.09.2024 | 0.15         | 0.15         | 0.15         |
| Gebühren Kauf / Verkauf in % <sup>4</sup>                 | 0.06         | 0.06         | 0.06         |

<sup>1</sup> Die Style Box zeigt die Anlagestrategie eines Fonds an.

<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 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.

<sup>4</sup> zu Gunsten der Anlagegruppe

Datenquelle Benchmark: SIX Swiss Exchange