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 56.72 Mio.
Basisportfolio	CHF 138.47 Mio.
Anzahl Positionen	72
Kursquelle	Bloomberg ISTASPL istfunds.ch
NAV Kategorie I	CHF 2'301.32
NAV Kategorie II	CHF 2'314.86
NAV Kategorie III	CHF 2'377.12

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	1.22%
Beta	0.94

ESG

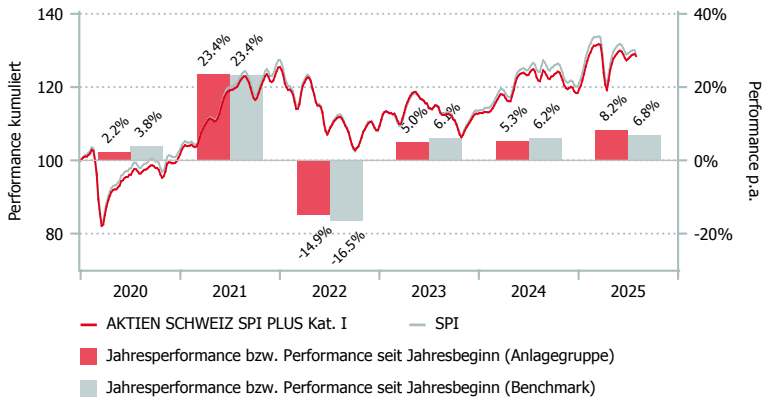
Stimmrechtausübung	Ja
Ausschlussliste	Ja

Anlagepolitik

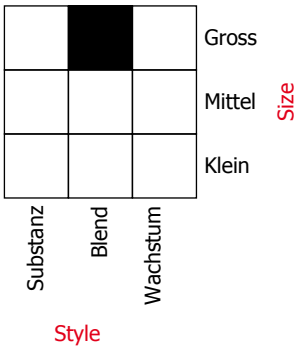
AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS ist eine aktiv, nach einem quantitativen Modellansatz bewirtschaftete Anlagegruppe. Die Titel des Swiss Performance Indexes (SPI) bilden das Universum. Der Fokus des eingesetzten Titelselektionsmodells liegt auf den Aspekten Profitabilität (z.B. ROE, Cashflow), Momentum (z.B. 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 verantwortungsbewuss- te 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.

Performance in CHF (in %, netto nach Kosten)



Style Box[1]



	1 Mt.	3 Mt.	6 Mt.	1 J.	3 J.*	5 J.*	Vol. 3 J.
ASPI Kat. I	0.91	1.51	0.44	2.66	4.73	6.18	10.63
ASPI Kat. II	0.92	1.53	0.47	2.73	4.79	6.24	10.63
ASPI Kat. III	0.92	1.54	0.49	2.77	4.84	6.29	10.63
BM	-0.06	0.28	-1.29	1.03	4.58	5.90	11.24

*annualisiert

	2019	2020	2021	2022	2023	2024	YTD
ASPI Kat. I	29.77	2.19	23.44	-14.89	5.02	5.31	8.18
ASPI Kat. II	29.87	2.25	23.51	-14.84	5.08	5.38	8.22
ASPI Kat. III	29.92	2.30	23.56	-14.80	5.12	5.42	8.24
BM	30.59	3.82	23.38	-16.48	6.09	6.18	6.81

AKTIEN SCHWEIZ SPI PLUS (ASPI)

Aufteilung des Portfolios (in %)

Top 10 (in %)

	ASPI	BM
Novartis (N)	12.3	11.7
Nestlé (N)	11.2	11.6
Roche (GS)	10.7	11.4
UBS Group (N)	6.5	5.8
ABB Ltd (N)	6.0	5.3
Zurich Insurance Grp (N)	5.8	5.2
Cie Fin. Richemont (N)	3.8	4.5
Swiss Re AG (N)	3.4	2.7
Holcim (N)	2.9	2.2
Geberit (N)	2.1	1.3

Branchen (in %)

	ASPI	BM
Gesundheitswesen	30.0	33.8
Finanzwesen	21.7	20.5
Industrie	19.1	13.8
Basiskonsumgüter	13.6	13.7
Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe	6.1	8.1
Nicht-Basiskonsumgüter	4.6	5.3
IT-Dienstleistungen	3.1	1.8
Versorger	1.8	0.3
Telekomdienstleistungen	0.6	1.2
Immobilien	0.1	1.7
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[2] in % p.a. per 30.09.2024	0.31	0.25	0.21
davon TER Zielfonds[3] in % p.a. per 30.09.2024	0.15	0.15	0.15
Gebühren Kauf / Verkauf in %[4]	0.06	0.06	0.06

[1] *Die Style Box zeigt die Anlagestrategie eines Fonds an.*

[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 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.*

[4] *zu Gunsten der Anlagegruppe*

Datenquelle Benchmark: SIX Swiss Exchange