

Daten per 31.10.2024

Ziele und Investitions Universum

Anlageklasse Hedgefonds UCITS
Kategorie Alternative Funds

Der BCV Systematic Premia Global strebt einen langfristigen Kapitalzuwachs und eine geringe Korrelation zu den wichtigsten Anlageklassen an. Er zielt daher darauf ab, unabhängig von den Marktbedingungen eine positive absolute Rendite zu erzielen und bietet somit grosses Diversifizierungspotenzial für traditionelle Portfolios. Er verfolgt dieses Ziel, indem er in eine breite Palette alternativer Risikoprämien investiert, mit denen Positionen in Strategien wie Equity Market Neutral, Trend Following und Macro Trading nachgebildet werden können. Diese Strategien werden in verschiedenen Anlageklassen umgesetzt, wie Aktien, Währungen, Anleihen und Rohstoffe.

Klasse C (USD): für Anleger offen, die Anteile im Wert von mindestens 30 Millionen CHF (oder Gegenwert) zeichnen und halten. In US-amerikanischem Dollar denominated.

Fondscharakteristik

Rechtliche Struktur FCP
Fondsdomizil Luxemburg
Portfoliomanager Frederic Sonney
Maxime Borel
Lancierungsdatum 08.03.2022
Valorennummer / ISIN 58470318 / LU2264523890
Referenzwährung USD
Handelbarkeit Wöchentlich
NIW USD 106.85
Extremkurse 2024 USD 112.80 / 106.85
Fondsvermögen in Mio. USD 34.04
Pauschalkommission 0.75%
TER vom 30.06.2024 0.78%
Letzte Ausschüttung keine Ausschüttung

Nebenkosten (zugunsten des Fonds) Ausgabe / Rücknahme: :
0.10% / 0.10%

Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

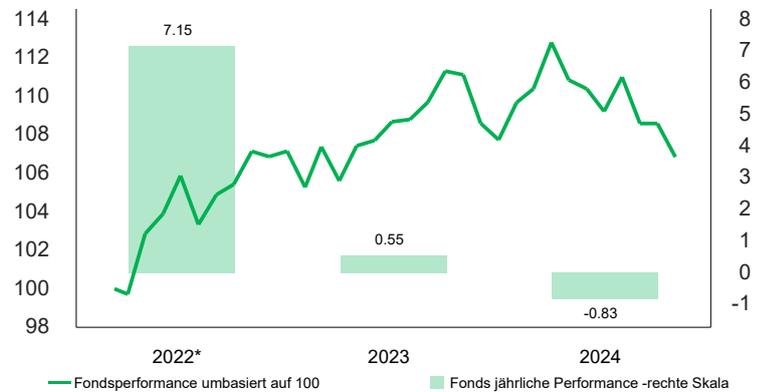
Annahmetag / -uhrzeit Kundenaufträge T-1 13:15* / T-1 14:00**
NIW-Datum (Referenzdatum für die Marktkurse) T (=Dienstag)
Werterstellungsdatum max. T+3
Handelbarkeit Wöchentlich

*Cut-off-Zeit bei der BCV

**Cut-off-Zeit bei der EFA

Performance in USD (%)

	1 Monat	3 M.	YTD	1 Jahr	annualisiert	
					3 Jahre	5 Jahre
Fonds	-1.60	-3.74	-0.83	-3.84	-	-
Volatilität⁽¹⁾				5.22	-	-
Sharpe Ratio⁽¹⁾				-1.81	-	-



* Seit 08/03/2022

Risikoprofil



Der synthetische Risikoindikator (SRI) ermöglicht es, das Risikoniveau dieses Produkts im Vergleich zu anderen unter Berücksichtigung von Markt- und Kreditrisiken zu bewerten. Seine Berechnungsmethode beruht auf der Annahme, dass der Anleger den Fonds während der empfohlenen Haltedauer hält.

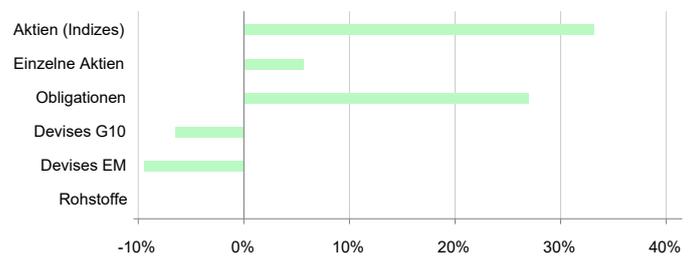
Daten per 31.10.2024

Beitrag zur Bruttoperformance (in %)

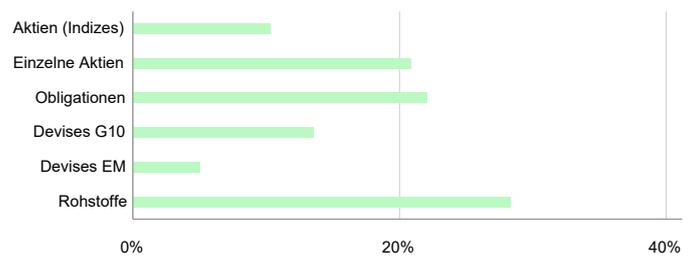
	Allokation*	mtd	ytd*	itd
Equity Market Neutral	33.33	-0.41	-0.69	0.53
Equity MN Value	6.84	-0.17	-1.39	0.45
Equity MN Momentum	5.54	0.93	2.75	5.53
Equity MN LowBeta	6.01	-0.40	1.46	-0.21
Equity MN Size	8.33	-0.31	-2.48	-4.29
Equity MN Quality	6.61	-0.46	-1.02	-0.95
Trend following	33.33	-2.28	-5.00	-3.10
Trend Equity	11.11	-0.50	-0.18	-2.15
Trend Fixed Income	11.11	-1.00	-2.45	0.87
Trend FX	11.11	-0.78	-2.37	-1.82
Macro Trading	33.33	0.76	1.62	2.05
FI Carry	8.32	0.52	1.10	0.27
FX Value	6.30	-0.29	-0.95	-1.63
FX Carry	6.05	0.13	0.83	1.58
Commo Carry Cross	8.38	0.29	0.05	0.50
Commo Carry Slope	4.28	0.11	0.59	1.33
Total	100.00	-1.94	-4.07	-0.51

* in % des Gesamtrisikos

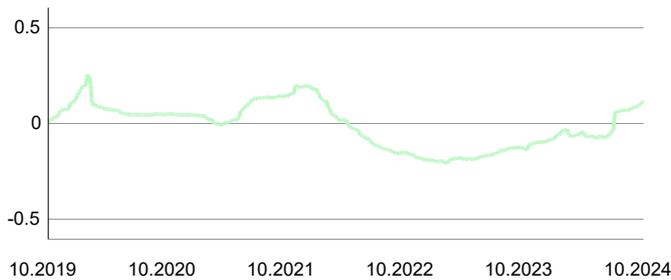
Nettoengagement, nach Anlageklasse



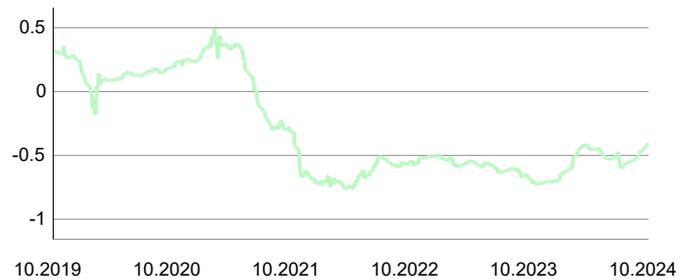
Bruttoexposition, nach Anlageklassen (in % des 3.53x)



Beta am Aktienmarkt, 1 Jahr rollierend**



Beta am Anleihenmarkt, 1 Jahr rollierend**



** Simulierte Statistiken vor Auflegung am 8. März 2022

Statistik über 3 Jahre*** Fonds

Gesamtrendite	6.85%
Annualisierte Performance	2.54%
Sharpe Ratio ⁽¹⁾	-0.38
Positive Monate	61.29%
Max. Drawdown ⁽¹⁾	-5.27%

Risikofreier Zinssatz 4.67%

*** oder seit Lancierung wenn weniger als 3 Jahre

Monatliche Performance in USD (%)

	2020	2021	2022	2023	2024
	Fonds	Fonds	Fonds	Fonds	Fonds
Januar				-1.75	1.80
Februar				1.99	0.65
März			-0.28	-1.65	2.18
April			3.15	1.72	-1.73
Mai			1.01	0.26	-0.41
Juni			1.91	0.90	-1.06
Juli			-2.40	0.11	1.63
August			1.50	0.83	-2.17
September			0.51	1.47	0.00
Oktober			1.62	-0.17	-1.60
November			-0.25	-2.27	
Dezember			0.26	-0.79	
Jahr			7.15	0.55	-0.83

Daten per 31.10.2024

BCV Asset Management
Place St-François 14
1003 Lausanne
Tel. 021/212 20 51
Email: fonds@bcv.ch
Website: www.bcv.ch/invest

BCV Asset Management
Talstrasse 70
8001 Zürich
Tel. 044/ 388 71 30
Email: fonds@bcv.ch

BCV Fund Desk
Place St-François 14
1003 Lausanne - Suisse
Tel. 021/ 212 40 26
Fax. 021/ 212 16 56
Email: fund.desk@bcv.ch

Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat
1, Place de Metz
L-2954 Luxembourg
Tel. (+352) 4015-1

⁽¹⁾ Berechnungshäufigkeit der Risikodaten: monatlich

Bezugsquelle: BCV / GERIFONDS/ EFA
Copyright BCV

WICHTIGE INFORMATIONEN

Dieses Dokument ist ein monatliches Marketing-Merkblatt. Die Informationen und Meinungen in diesem Dokument stammen aus Quellen, die am Datum der Drucklegung als zuverlässig beurteilt wurden. Sie begründen keine Haftung der BCV und können jederzeit ohne Vorankündigung geändert werden. Dieses Dokument wurde von unserer Asset-Management-Abteilung ausschliesslich zu Informationszwecken verfasst. Es stellt weder eine Ausschreibung noch ein Kauf- oder Verkaufsangebot, noch eine persönliche Anlageempfehlung oder eine Finanzanalyse im Sinne der Richtlinien zur Sicherstellung der Unabhängigkeit der Finanzanalyse der Schweizerischen Bankiervereinigung dar. Die Jahres- und Halbjahresberichte, die Fondsprospekte und die Fondsverträge sowie die KID aller von der BCV verwalteten oder vertriebenen Anlagefonds können kostenlos bei der BCV (Zahlstelle), Place St-François 14, 1003 Lausanne, oder bei der Fondsleitung GERIFONDS SA, Fonds Vertreter, bezogen werden (www.gerifonds.ch). Die mit bestimmten Anlagen, insbesondere mit alternativen Anlagen, Derivaten- und Schwellenländeranlagen verbundenen Risiken eignen sich nicht für alle Anleger. Für genauere Produktangaben konsultieren Sie bitte die Swiss Banking-Broschüre Besondere Risiken im Effektenhandel. Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe- und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt. Da der Teilfonds keinen Referenzindex hat, wird seine Wertentwicklung nicht mit einem solchen Index verglichen. Die BCV-Gruppe konnte den Inhalt dieser Publikation vor der Veröffentlichung für Transaktionen nutzen. Die Verbreitung dieses Dokuments und/oder der Verkauf bestimmter Produkte können für Personen, die anderen Rechtsordnungen als der schweizerischen unterstehen, untersagt sein oder Einschränkungen unterliegen (z.B. EU, Grossbritannien, USA und US-Personen).