

Daten per 30.09.2024

## 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 (CHF): für Anleger offen, die Anteile im Wert von mindestens 30 Millionen CHF (oder Gegenwert) zeichnen und halten. In Schweizer Franken denominiert und gegen Wechselkursrisiken abgesichert.

## Fondscharakteristik

Rechtliche Struktur	FCP
Fondsdomizil	Luxemburg
Portfoliomanager	Frederic Sonney Maxime Borel
Lancierungsdatum	08.03.2022
Valorennummer / ISIN	58470355 / LU2264524948
Referenzwährung	CHF
Handelbarkeit	Wöchentlich
NIW	CHF 99.81
Extremkurse 2024	CHF 105.77 / 99.10
Fondsvermögen in Mio.	USD 35.61
Pauschalkommission	0.75%
TER vom 30.06.2024	0.78%
Letzte Ausschüttung	keine Ausschüttung

Nebenkosten (zugunsten des Fonds) Ausgabe / Rücknahme: :  
 0.12% / 0.12%

## 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 CHF (%)

	1 Monat	3 M.	YTD	1 Jahr	annualisiert	
					3 Jahre	5 Jahre
<b>Fonds</b>	<b>-0.37</b>	<b>-1.58</b>	<b>-2.02</b>	<b>-6.12</b>	-	-
<b>Volatilität<sup>(1)</sup></b>				<b>5.06</b>	-	-
<b>Sharpe Ratio<sup>(1)</sup></b>				<b>-1.53</b>	-	-



\* 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.

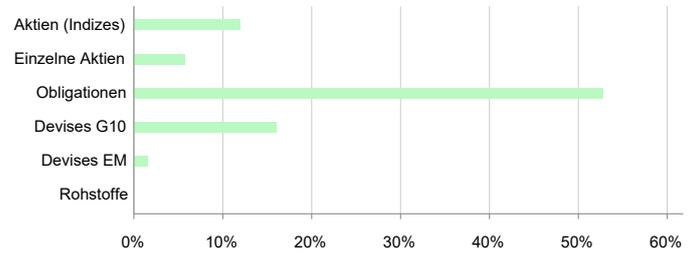
Daten per 30.09.2024

## Beitrag zur Bruttoperformance (in %)

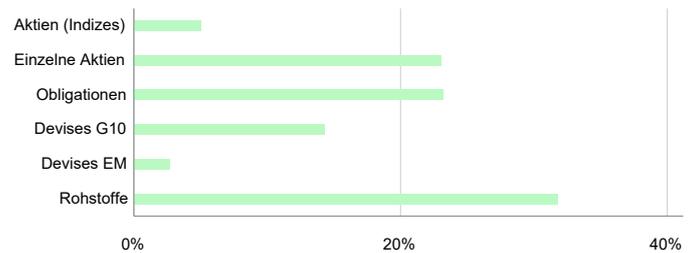
	Allokation*	mtd	ytd*	itd
<b>Equity Market Neutral</b>	<b>33.42</b>	<b>-0.63</b>	<b>-0.19</b>	<b>1.15</b>
Equity MN Value	6.86	-0.64	-1.06	0.88
Equity MN Momentum	5.55	-0.25	1.43	4.11
Equity MN LowBeta	6.02	-0.07	2.01	0.37
Equity MN Size	8.35	0.36	-2.09	-3.87
Equity MN Quality	6.63	-0.04	-0.48	-0.34
<b>Trend following</b>	<b>33.45</b>	<b>0.68</b>	<b>-2.96</b>	<b>-1.16</b>
Trend Equity	11.15	0.11	0.31	-1.74
Trend Fixed Income	11.15	0.35	-1.58	1.74
Trend FX	11.15	0.22	-1.69	-1.17
<b>Macro Trading</b>	<b>33.14</b>	<b>-0.44</b>	<b>0.97</b>	<b>1.47</b>
FI Carry	9.06	0.04	0.61	-0.23
FX Value	6.15	-0.05	-0.65	-1.30
FX Carry	5.82	0.06	0.73	1.50
Commo Carry Cross	7.96	-0.31	-0.23	0.23
Commo Carry Slope	4.16	-0.18	0.50	1.26
<b>Total</b>	<b>100.00</b>	<b>-0.39</b>	<b>-2.18</b>	<b>1.45</b>

\* in % des Gesamtrisikos

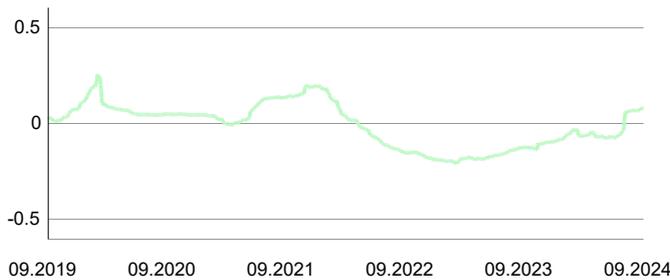
## Nettoengagement, nach Anlageklasse



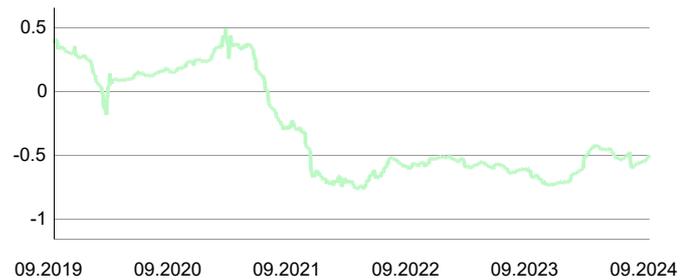
## Bruttoexposition, nach Anlageklassen (in % des 3.18x)



## 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	-0.19%
Annualisierte Performance	-0.07%
Sharpe Ratio <sup>(1)</sup>	-0.15
Positive Monate	50.00%
Max. Drawdown <sup>(1)</sup>	-6.12%

Risikofreier Zinssatz 0.88%

\*\*\* oder seit Lancierung wenn weniger als 3 Jahre

## Monatliche Performance in CHF (%)

	2020	2021	2022	2023	2024
	Fonds	Fonds	Fonds	Fonds	Fonds
Januar				-2.07	1.51
Februar				1.71	0.35
März			-0.36	-2.12	1.93
April			3.10	1.43	-2.07
Mai			0.89	-0.09	-0.77
Juni			1.83	0.53	-1.33
Juli			-2.59	-0.16	1.27
August			1.32	0.49	-2.45
September			0.40	1.25	-0.37
Oktober			1.44	-0.50	
November			-0.48	-2.58	
Dezember			-0.20	-1.15	
<b>Jahr</b>			<b>5.38</b>	<b>-3.33</b>	<b>-2.02</b>

Daten per 30.09.2024

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

BCV Asset Management  
Talstrasse 70  
8001 Zürich  
Tel. 044/ 388 71 30  
Email: [fonds@bcv.ch](mailto: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](mailto:fund.desk@bcv.ch)

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

<sup>(1)</sup> 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](http://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 Kostenunberücksichtigt. 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).