

Daten per 30.06.2024

Ziele und Investitions Universum

| | |
|--------------|---------------|
| Anlageklasse | Anleihen |
| Kategorie | Staatspapiere |

Das Anlageziel des BCV Fiscal Strength Government Bonds besteht darin, in der Wertentwicklung langfristig besser als sein sich aus öffentlichen Anleihen zusammensetzender Referenzindex abzuschneiden. Das Portfolio wird anhand einer Analyse der Qualität der Fundamentalwerte der in Betracht gezogenen Länder wie auch der Auswertung seiner Laufzeiten und der damit verbundenen Zinsänderungsrisiken dynamisch gemanagt. Dieser Fonds richtet sich an Investoren, die ihre Vermögenswerte in internationale öffentliche Anleihen mit dem Schweizer Franken als Referenzwährung diversifizieren möchten. Die Wechselkursrisiken werden nicht systematisch abgedeckt.

Klasse B: offen i) für alle Anleger, die Anteile im Wert von mindestens 5 Millionen CHF zeichnen und halten, ii) für solche, deren Anteile im Rahmen eines Verwaltungs- oder Beratungsvertrags gemäss Bestimmungen des Fondsvertrags gezeichnet wurden, iii) für kollektive Kapitalanlagen.

Fondscharakteristik

| | |
|------------------------------|----------------------------------|
| Rechtliche Struktur | Anlagefonds |
| Fondsdomizil | Schweiz |
| Fondsmanager | Julien Marcel Dominic Purches |
| Referenzindex | BBG Gl. Tsy Fiscal Str. |
| Lancierungsdatum | 06.09.2017 |
| Valorennummer / ISIN | 36427669 / CH0364276698 |
| Referenzwährung | CHF |
| Handelbarkeit | Täglich |
| NIW | CHF 75.49 |
| Extremkurse 2024 | CHF 77.91 / 73.91 |
| Fondsvermögen in Mio. | CHF 575.15 |
| Pauschalkommission | 0.40% |
| TER vom 30.09.2023 | 0.42% |
| Letzte Ausschüttung (brutto) | CHF 1.30 |

Nebenkosten (zugunsten des Fonds) Ausgabe / Rücknahme: : 0.10% / 0.05%

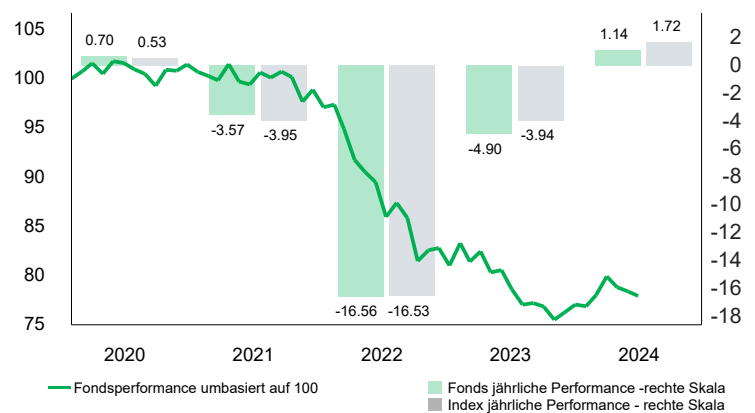
Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

| | |
|--|----------|
| Annahmetag / -uhrzeit Kundenaufträge | T 16:00* |
| NIW-Datum (Referenzdatum für die Marktkurse) | T |
| Werterstellungsdatum | T+2 |
| Handelbarkeit | Täglich |

* Annahmeschluss bei der BCV

Performance in CHF (%)

| | 1 Monat | 3 M. | YTD | 1 Jahr | annualisiert | |
|-----------------------------------|--------------|--------------|-------------|--------------|--------------|--------------|
| | | | | | 3 Jahre | 5 Jahre |
| Fonds | -0.59 | -2.48 | 1.14 | -0.84 | -8.17 | -4.87 |
| Index | -0.55 | -2.06 | 1.72 | -0.13 | -7.74 | -4.69 |
| Volatilität⁽¹⁾ | | | | 5.87 | 6.59 | 5.82 |
| Index | | | | 5.13 | 5.93 | 5.49 |
| Sharpe Ratio⁽¹⁾ | | | | -0.42 | -1.31 | -0.88 |
| Index | | | | -0.34 | -1.38 | -0.85 |
| Tracking error | | | | 1.02 | 1.05 | 0.91 |



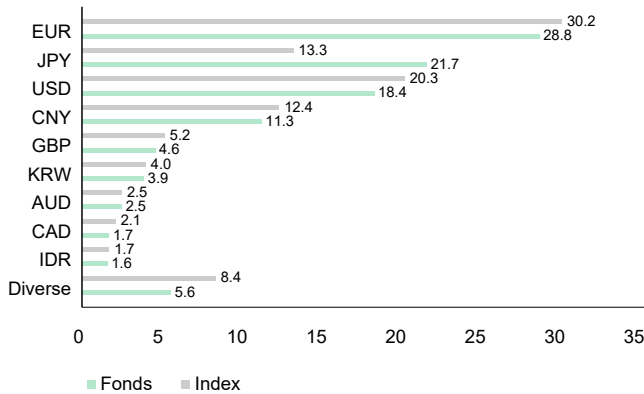
Risikoprofil



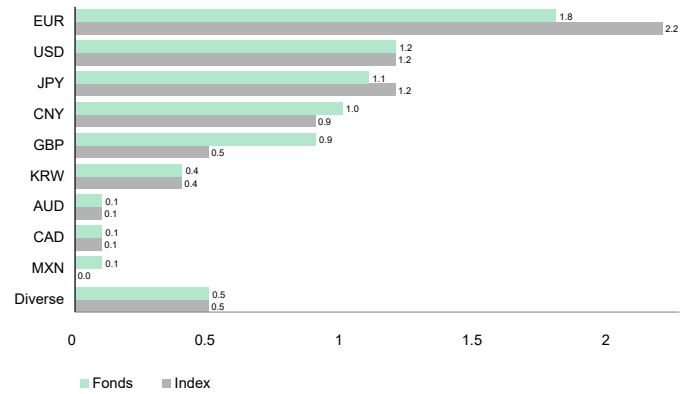
Der synthetische Risikoindikator (SRI) ermöglicht es, das Risikoniveau dieses Produkts im Vergleich zu anderen unter Berücksichtigung von Markt- und Kreditrisiken zu bewerten. Seine Berechnungsmethode beruht auf der Annahme, dass der Anleger den Fonds während der empfohlenen Haltedauer halt.

Daten per 30.06.2024

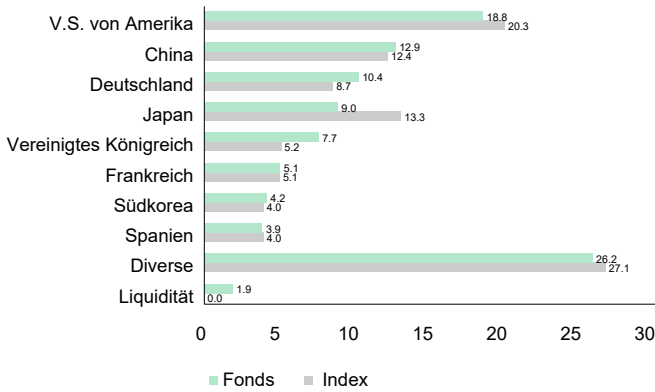
Aufschlüsselung nach Währungszone (%)



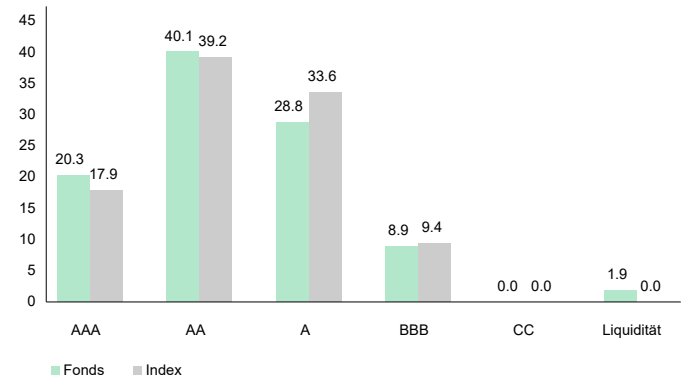
Beitrag zur Duration



Répartition géographique (%)



Qualität der Debitoren (%)



Statistik über 3 Jahre***

| | Fonds | Index | Fonds vs Index | Charakteristik | Fonds | Index |
|------------------------------|---------|---------|----------------|-------------------|--------|--------|
| Gesamttrendite | -22.56% | -21.48% | Tracking Error | Duration (Jahre) | 7.18 | 7.28 |
| Annualisierte Performance | -8.17% | -7.74% | Beta | Rendite (%) | 3.40 | 3.30 |
| Sharpe Ratio ⁽¹⁾ | -1.31 | -1.38 | Korrelation | Coupon (%) | 2.40 | 2.51 |
| Positive Monate | 38.89% | 41.67% | | Spread (bp) | 13 | 15 |
| Max. Drawdown ⁽¹⁾ | -27.37% | -26.47% | | Rating | AA/AA- | AA-/A+ |
| Risikofreier Zinssatz | 0.46% | | | Anzahl Positionen | 306 | 1874 |

*** oder seit Lancierung wenn weniger als 3 Jahre

Monatliche Performance in CHF (%)

| Monat | 2020 | | 2021 | | 2022 | | 2023 | | 2024 | |
|-------------|-------------|-------------|--------------|--------------|---------------|---------------|--------------|--------------|-------------|-------------|
| | Fonds | Benchmark | Fonds | Benchmark | Fonds | Benchmark | Fonds | Benchmark | Fonds | Benchmark |
| Januar | 0.75 | 0.77 | -0.42 | -0.47 | 0.27 | 0.26 | 2.79 | 2.82 | -0.23 | -0.14 |
| Februar | 0.81 | 0.85 | -0.43 | -0.44 | -2.53 | -2.46 | -2.24 | -2.02 | 1.46 | 1.40 |
| März | -1.04 | -1.59 | 1.64 | 1.55 | -3.32 | -3.20 | 1.26 | 1.18 | 2.45 | 2.57 |
| April | 1.27 | 1.31 | -1.74 | -1.74 | -1.34 | -0.92 | -2.57 | -2.36 | -1.37 | -0.93 |
| Mai | -0.18 | -0.25 | -0.30 | -0.28 | -1.15 | -1.25 | 0.28 | 0.33 | -0.54 | -0.60 |
| Juni | -0.62 | -0.65 | 1.22 | 1.19 | -3.93 | -3.76 | -2.43 | -2.01 | -0.59 | -0.55 |
| Juli | -0.46 | -0.41 | -0.51 | -0.45 | 1.65 | 1.33 | -1.97 | -2.19 | | |
| August | -1.21 | -1.21 | 0.61 | 0.59 | -1.75 | -1.94 | 0.20 | 0.14 | | |
| September | 1.64 | 1.66 | -0.56 | -0.61 | -5.11 | -4.62 | -0.44 | 0.17 | | |
| Oktober | -0.10 | -0.01 | -2.48 | -2.43 | 1.35 | 1.11 | -1.75 | -1.59 | | |
| November | 0.64 | 0.70 | 1.24 | 1.01 | 0.28 | 0.02 | 0.98 | 0.65 | | |
| Dezember | -0.74 | -0.59 | -1.80 | -1.86 | -2.14 | -2.30 | 1.04 | 1.03 | | |
| Jahr | 0.70 | 0.53 | -3.57 | -3.95 | -16.56 | -16.53 | -4.90 | -3.94 | 1.14 | 1.72 |

Daten per 30.06.2024

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
Talacker 35
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

⁽¹⁾ Berechnungshäufigkeit der Risikodaten: wöchentlich

Bezugsquelle: BCV / GERIFONDS / BLOOMBERG
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, Place St-François 14, 1003 Lausanne, oder bei der Fondsleitung GERIFONDS SA (www.gerifonds.ch) bezogen werden. 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. 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).