



Swisscanto (LU) Equity Fund Systematic Responsible Selection International AT

Aktien | thesaurierend | September 2020

Valoren Nummer: 2278995
ISIN-Nummer: LU0230112046

Bloomberg: SWEFSIB LX

Fondsbeschreibung

Der Fonds investiert mittels proprietärem systematischem Investitionsansatz weltweit in Aktien von Unternehmen. Die Selektion der Aktien basiert auf Faktoren wie Value (tief bewertete Aktien), Quality (Qualitätsaktien) und Momentum (Aktien mit positivem Trend). Das Portfolio ist sektorneutral und länderneutral. Zusätzlich kann der Fonds eine Long-Short-Strategie (130/30) mittels Derivaten einsetzen.

Profil/Eignung

Dieses Produkt ist für Anleger geeignet, welche

- einen langfristigen Anlagehorizont haben.
- an der Entwicklung des internationalen Aktienmarktes teilhaben möchten.
- an einem hohen Kapitalwachstum interessiert sind.
- bereit sind, grosse Kursschwankungen in Kauf zu nehmen.

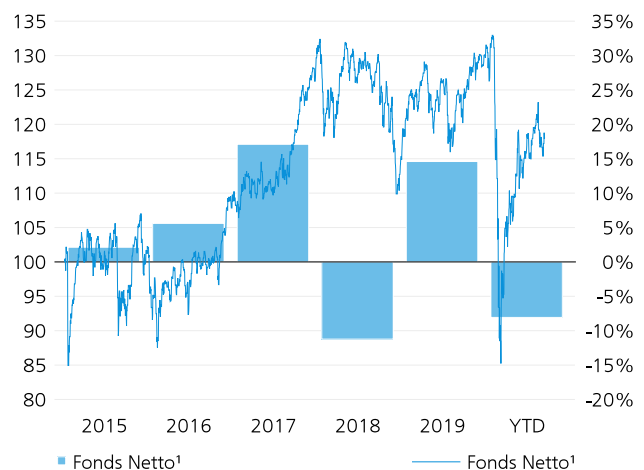
Risikoindikator

tief < 1 2 3 4 5 6 7 > hoch

Fondsdaten

NAV pro Anteil (30.09.2020)	CHF 173.28
52-Wochen-Hoch (14.02.2020)	CHF 195.05
52-Wochen-Tief (23.03.2020)	CHF 125.05
Fondsdomizil	Luxemburg
Referenzwährung Anteilsklasse	CHF
Fondswährung	CHF
Abschluss Rechnungsjahr	31.03.
Lancierungsdatum Anteilsklasse	18.11.2005
Lancierungsdatum Fonds	18.11.2005
Start Performancemessung	01.12.2005
Klassenvermögen (Mio.)	CHF 29.17
Fondsvermögen (Mio.)	CHF 83.88
Ausstehende Anteile	168'358.845
Benchmark	MSCI® World TR Net
Pauschale Management Fee p.a.	1.45%
Pauschale Verwaltungskomm. p.a.	1.80%
Total Expense Ratio p.a.	1.86%
Swinging Single Pricing	Ja
Verwaltungsgesellschaft	Swisscanto Asset Management International S.A., Luxemburg
Portfolio Management	Zürcher Kantonalbank
Depotbank	RBC Investor & Treasury Services

Indizierte Wertentwicklung und Wertentwicklung in %



Seit Start Performancemessung (Start Messung Wertentwicklung) oder maximal seit den letzten 5 Jahren. Indizierte Wertentwicklung (linke Skala). Wertentwicklung in Prozent pro Jahr (rechte Skala).

Performance in %

Seit	1Mt	3Mte	1J	3J p.a.	5J p.a.	10J p.a.
Fonds Netto ¹	-1.75	3.29	-5.03	0.25	4.90	6.98
Fonds Brutto ²	-1.60	3.77	-3.25	2.15	6.90	9.00
Benchmark	-1.49	4.65	1.73	5.95	9.25	8.76

Geringe Abweichungen können aufgrund von Rundungen auftreten.

Jahresperformance in %

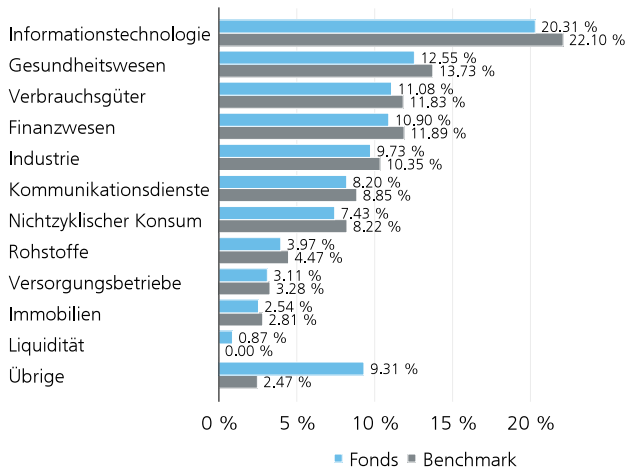
Jahr	2015	2016	2017	2018	2019	YTD
Fonds Netto ¹	2.13	5.60	17.10	-11.23	14.60	-8.07
Fonds Brutto ²	4.03	7.59	19.40	-9.52	16.74	-6.78
Benchmark	-0.18	9.63	17.34	-7.62	25.41	-3.51

Jahr/Periode: Seit Start Performancemessung (Start Messung Wertentwicklung) oder für das gesamte Jahr/Periode. Geringe Abweichungen können aufgrund von Rundungen auftreten.

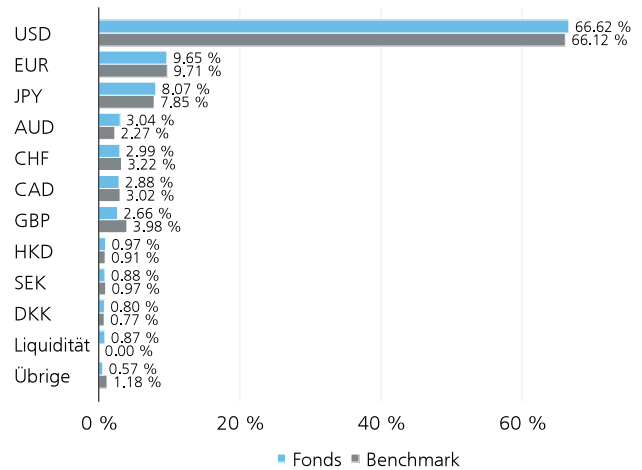
¹ Die dargestellte Nettowertentwicklung versteht sich abzüglich aller regelmässig anfallenden Fondsgebühren. Darüberhinausgehende, eventuell anfallende Kosten, welche dem Fondsvermögen direkt belastet werden können, sind im Verkaufsprospekt des Fonds offengelegt.

² Die abgebildete Bruttowertentwicklung zeigt die Entwicklung vor Abzug aller regelmässig anfallenden Fondsgebühren.

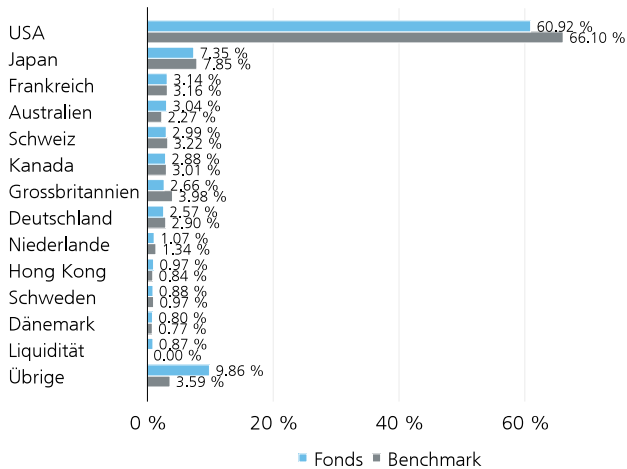
Aufteilung nach Sektoren



Aufteilung nach Währungen



Länderaufteilung



Nachhaltigkeitsindikator

hoch < A B **C** D E F G > niedrig

Die grössten Positionen in %

	Fonds	BM
Apple Inc	4.82	4.46
Microsoft Corp	3.76	3.37
Amazon.com Inc	2.74	2.97
Alphabet Inc	2.52	1.97
Procter & Gamble Co	1.44	0.76
Johnson & Johnson	1.38	0.87
Facebook Inc	1.33	1.40
Nestlé SA	1.29	0.79
Adobe Inc	1.03	0.53
Roche Holding AG	1.00	0.54

Risikokennzahlen

annualisiert/realisiert	1J	3J	5J
Volatilität Fonds	23.09%	16.99%	14.96%
Volatilität Benchmark	22.10%	16.63%	14.52%
Beta	1.04	1.01	1.02
Sharpe Ratio	-0.19	0.06	0.37
Jensen's Alpha	-6.97%	-5.62%	-4.25%
Information Ratio	-3.96	-2.44	-1.85

Positionskennzahlen

	Fonds	BM
Anzahl Positionen	551	1'606

Erläuterungen zum Fonds

Anlegerkreis - Bezeichnung

Alle Anleger

Anlegerkreis - Beschreibung

Die A Klasse wird allen Anlegern angeboten. Der zweite Buchstabe «T» gibt Aufschluss darüber, dass die Klasse die Erträge reinvestiert (thesaurierend). Es wird eine pauschale Verwaltungskommission belastet.

Pauschale Verwaltungskommission (PVK)

Die PVK wird verwendet für die Leitung, das Asset Management und, sofern entschädigt, den Vertrieb des Fonds wie auch für die Entschädigung der Depotbank für die von ihr erbrachten Dienstleistungen. Die PVK setzt sich aus den zwei Bestandteilen pauschale Management Fee (PMF) und pauschale Administration Fee (Kosten für Leitung und für Administration) zusammen.

Pauschale Management Fee (PMF)

Die PMF wird für das Asset Management und, sofern entschädigt, den Vertrieb des Fonds verwendet. Die PMF ist ein Bestandteil der PVK.

Total Expense Ratio (TER)

Die TER bezeichnet die Kommissionen, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), und wird in einem Prozentsatz des Fondsvermögens ausgedrückt. Die Angabe entspricht der Höhe der TER im zuletzt abgeschlossenen Geschäftsjahr und bietet keine Gewähr für eine entsprechende Höhe in der Zukunft.

Swinging Single Pricing (SSP)

Situative Korrektur des für die Berechnung des Ausgabe- und Rücknahmepreises massgebenden Inventarwertes nach oben oder unten je nach überwiegenden Anteilausgaben oder Rücknahmen, wobei sich der Korrektur (Swing)-Faktor nach der Höhe der Kosten richtet, die dem Anlagefonds bei der Anpassung des Portefeuilles an die zu- bzw. abgeflossenen Mittel entstehen (neutralisiert die den Anlagefonds bei der Anpassung des Vermögens an Mittelzu- und -abflüsse entstehenden Kosten). Die ausgewiesene Wertentwicklung (Brutto/Netto) kann eine Swing-Price Anpassung beinhalten.

Vergleichsbenchmark

Es handelt sich hier lediglich um eine Vergleichsbenchmark. Die Performance des Fonds steht in keiner Abhängigkeit zur Benchmark, insbesondere im Hinblick auf die Portfoliozusammensetzung.

Erläuterung der allgemeinen Risiken

Die Anlage unterscheidet sich von einer Anlage in Einlagen. Mit der Anlage sind Risiken, insbesondere diejenigen von Wert-, Kapital- und Ertragschwankungen, verbunden. Anlagen in Fremdwährungen weisen Wechselkursschwankungen auf. Weitere erhebliche Risiken stellen das Verwahrungs- sowie das Gegenpartierisiko dar. Wir verweisen auf die detaillierte Beschreibung der verschiedenen Risiken, die im Verkaufsprospekt und/oder in den Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) aufgeführt werden.

Risikoindikator

Die zur Berechnung der Risiko- und Ertragskategorie verwendeten historischen Daten können nicht als verlässlicher Hinweis auf das künftige Risikoprofil herangezogen werden. Die ausgewiesene Risiko- und Ertragskategorie kann durchaus Veränderungen unterliegen. Die Einstufung in eine Kategorie stimmt mit der in den wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) ausgewiesenen überein. Die niedrigste Risikokategorie kann nicht mit einer risikofreien Anlage gleichgesetzt werden. Es besteht keine Kapitalgarantie bzw. kein Kapitalschutz. Das Risiko des Kapitalverlustes wird vom Anleger getragen.

Portfolio Allokationen

Alle Allokationen beziehen sich auf investiertes Fondskapital auf 100% adjustiert. Geringe Abweichungen der Differenzen können aufgrund von Rundungen auftreten.

Volatilität

Die Volatilität ist ein statistisches Risikomass, das angibt, wie stark die absoluten Renditen einer Anlage oder eines Portfolios durchschnittlich pro Jahr um deren Mittelwert schwanken.

Beta

Zeigt die relative Schwankungsbreite eines Wertpapiers im Verhältnis zum Gesamtmarkt. Sie misst die Sensitivität des Wertpapiers bezüglich dessen Kursänderungen gegenüber dem Gesamtmarkt. Liegt der Wert zwischen 0 - 1 ist die Kursänderung geringer als jene des Marktes. Ist das Beta grösser als 1 ist die Kursänderung des Wertpapiers im Durchschnitt höher als jene des Marktes. Ist sie kleiner als 0 wird eine gegenläufige Kursentwicklung des Wertpapiers zur Marktentwicklung beschrieben. Bei 0 ist keine Abhängigkeit zu erkennen.

Sharpe Ratio

Die Sharpe Ratio ist ein Performancemass, das die risikobereinigte Überschussrendite (Differenz zwischen Portfoliorendite und der risikolosen Rendite) im Verhältnis zum eingegangenen Anlagerisiko (Volatilität) zeigt.

Jensen's Alpha

Das Jensen's Alpha misst die Mehrrendite, die gegenüber einer vergleichbaren passiven Anlage (d.h. einer Anlage mit identischem Marktrisiko bzw. Beta) erreicht wird. Das Jensen's Alpha dient zur Beurteilung der Leistung eines Portfolio Managers. Es unterscheidet sich von der relativen Rendite (Überschussrendite), die nicht risikobereinigt ist.

Information Ratio

Die Information Ratio zeigt das Verhältnis zwischen der Unter- resp. Überperformance und dem Tracking Error. Sie gibt an, wie viel Mehr- oder Minderrendite pro Einheit eingegangenem aktiven Risiko erzielt wurde resp. inwieweit sich das aktive Risiko durch eine höhere Rendite ausbezahlt hat.

Nachhaltigkeitsindikator

Der Nachhaltigkeitsindikator beurteilt die Nachhaltigkeit von Kollektivprodukten, und zwar von nachhaltigen wie auch konventionellen Produkten. Der Kunde erhält damit eine Indikation, wie das Thema „Nachhaltigkeit“ in seinem Anlageportfolio abgebildet ist. Mit Daten aus den drei Dimensionen Umwelt (E), Reputation (S) und Corporate Governance (G), den sogenannten ESG-Kriterien, wird der Grad der Nachhaltigkeit von Anlagefonds ermittelt. Gemäss diesem Indikator werden die Anlagefonds in Nachhaltigkeits-Klassen von A (höchste Stufe) bis G (niedrigste Stufe) eingeteilt.

ISO Zertifizierung

Das Asset Management der Zürcher Kantonalbank ist ISO 9001 zertifiziert. Die Garantiemarke ISO 9001 gewährleistet, dass der Gebrauchsberechtigte über ein Managementsystem verfügt, das die Anforderungen eines entsprechenden, anerkannten Normmodells erfüllt und durch die Schweizerische Vereinigung für Qualitäts- und Management-Systeme (SQS) erfolgreich zertifiziert/bewertet wurde.

Rechtlicher Hinweis

Das vorliegende Dokument dient ausschliesslich Informations- und Werbezwecken, ist für die Verbreitung in der Schweiz bestimmt, und richtet sich nicht an Personen in anderen Ländern und an Personen, deren Nationalität oder Wohnsitz den Zugang zu solchen Informationen aufgrund der geltenden Gesetzgebung verbieten.

Jede Investition ist mit Risiken, insbesondere demjenigen von Wert- und Ertragsschwankungen, verbunden. Wertentwicklungen und Renditen der Vergangenheit sind keine Garantie für den zukünftigen Anlageerfolg. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Dieses Dokument wurde von Swisscanto und der Zürcher Kantonalbank mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt. Diese bieten jedoch keine Gewähr für die Richtigkeit und Vollständigkeit der darin enthaltenen Informationen und lehnen jede Haftung für Schäden ab, die sich aus der Verwendung des Dokumentes ergeben. Dieses Dokument ist weder ein Angebot zum Abschluss eines Vertrages noch eine Einladung zur Offertstellung für Bankprodukte und -dienstleistungen. Es stellt kein Angebot und keine Empfehlung zur Zeichnung oder Rückgabe bzw. für den Erwerb, das Halten oder den Verkauf von Finanzinstrumenten dar. Dem Empfänger wird empfohlen, die Informationen – allenfalls unter Beizug eines Beraters – in Bezug auf ihre Vereinbarkeit mit seinen persönlichen Verhältnissen auf juristische, regulatorische, steuerliche und andere Konsequenzen zu prüfen. Dieses Dokument ist kein Prospekt und kein Basisinformationsblatt.

Die in diesem Dokument beschriebenen Produkte und Dienstleistungen sind für US-Personen gemäss den einschlägigen Regulierungen nicht verfügbar.

Der Fonds ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) im Sinne der EU Richtlinie 2009/65/EG, der der Aufsicht der luxemburgischen Aufsichtsbehörde (CSSF) untersteht. Die aktuellen Fondsdokumente (Verkaufprospekt, Vertragsbedingungen, wesentliche Anlegerinformationen sowie Jahres- und Halbjahresberichte) können unter swisscanto.com, bei der Vertreterin in der Schweiz, der Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich, sowie bei den Vertriebssträgern der Swisscanto Fondsleitung AG in der Schweiz, über welche die Fondsanteile gezeichnet bzw. zurückgegeben werden, kostenlos bezogen werden. Zahlstelle in der Schweiz: Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich.