

ENISO Systematic Risk Klasse 4

ANLAGESTRATEGIE

Risikokontrolliert, systematisch und ertragsstark in ein abgerundetes Portfolio investieren

Rekordtiefe Zinsen führen zu einem Anlagenotstand. Der Ausweg in dividendenstarke Aktien oder traditionelle vermögensverwaltende Fonds, ist oft riskanter als erwartet. Wer erinnert sich nicht an die letzten Börsencrashes, die teilweise sogar zu erheblichen Substanzverlusten verführten. Der ENISO Systematic Risk bietet mit einem vielversprechenden Investmentansatz den Ausweg aus diesem Anlagedilemma.

Der ENISO Systematic Risk wurde mit einem Ziel entwickelt: Das Risikoprofil eines festverzinslichen Wertpapierdepots abzubauen und gleichzeitig über mittlere Frist eine höhere Rendite zu erzielen.

UMSETZUNG

Um diesem anspruchsvollen Ziel gerecht zu werden, schufen unsere Investmentspezialisten ein risikokontrolliertes, systematisches und ertragsstarkes Portfoliokonzept, das die Marktrisiken anhand einer Vielzahl Faktoren misst und steuert. Vier Erfolgspfeiler zeichnen den ENISO Systematic Risk aus:

Für die aktive Rendite:

ENISO's Risikoappetit-Indikator steuert das Vermögen ziel-sicher zwischen Aktien und Obligationen frei von Emotionen - risikokontrolliert und prognosefrei.

Für die Stabilität:

Ein Sockelbetrag wird in ausgewählte und qualitativ hochstehende Obligationen durch unsere Spezialisten investiert.

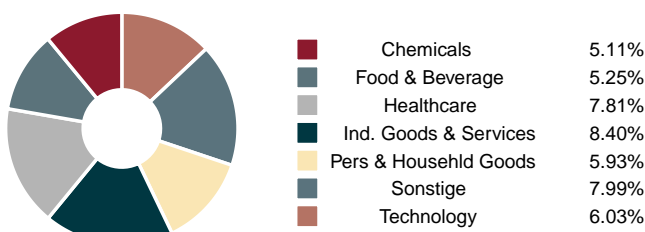
Für das Ungewisse:

Durch Volatilitäts- und/oder FX-Instrumente (Alternative Anlagen) werden unvorhersehbare Ereignisse („black swans“) mit ihren negativen Renditeauswirkungen abgedeckt.

Für die defensive Rendite:

Ein spezifisch für den ENISO Systematic Risk entwickeltes Faktorensatz investiert auf smarte Weise in Aktien mit besonders stabilem Geschäftsverlauf.

SEKTORENAUFTEILUNG



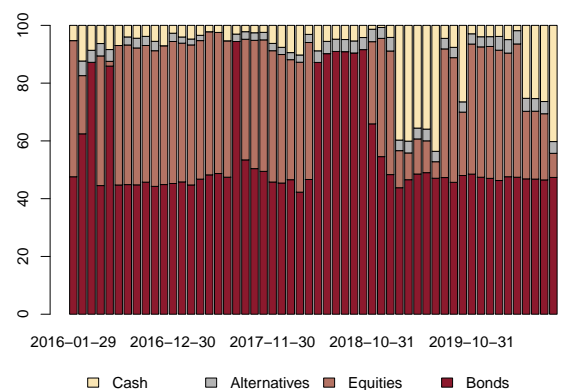
WERTENTWICKLUNG



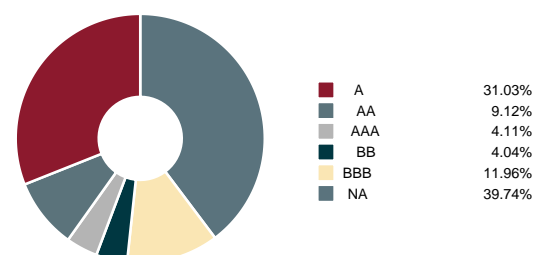
QUARTALSWEISE WERTENTWICKLUNG

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 | YTD |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 2015 | | -2.32 | -4.17 | 4.17 | -2.49 |
| 2016 | -2.24 | 2.36 | 0.72 | 1.96 | 2.77 |
| 2017 | 1.56 | 0.55 | 0.16 | 0.27 | 2.55 |
| 2018 | -2.16 | -0.49 | -0.89 | -3.12 | -6.51 |
| 2019 | 2.8 | 2.47 | -0.21 | 1.4 | 6.59 |
| 2020 | -9.84 | 3.74 | 0.46 | | -6.04 |

VERMÖGENSALLOKATION IM ZEITVERLAUF



SCHULDNER RATINGSTRUKTUR



ENISO Systematic Risk Klasse 4



FONDSDATEN

| | |
|-------------------------------|------------|
| Auflage | 06.05.2015 |
| Inventarwert pro Anteil (NAV) | 95.18 CHF |
| Aktienquote | 8.347% |
| Anzahl Unternehmen | 57 |

FONDSFAKTEN

| | |
|----------------------------|--|
| Name | ENISO Systematic Risk Klasse 4 |
| ISIN / WKN / Valorenummer | CH0270982249 / A2AC5F / 27098224 |
| Bloomberg | ENSRCH4 SW |
| Vermögensverwalter | ENISO Partners AG, Zürich |
| Fondswährung | CHF |
| Rechtsform | Effektenfonds |
| Fondsdomizil | Schweiz |
| Vertriebszulassung | Schweiz, Deutschland |
| Ertragsverwendung | Thesaurierung |
| Fondsleitung | LLB Swiss Investment AG, Zürich |
| Depotbank | Bank J. Safra Sarasin AG, Basel |
| Zeichnungen / Rücknahmen | Bankwerktätlich bis 13.00 Uhr |
| Kurspublikation | www.llbsswiss.ch www.swissfunddata.ch |
| Ausgabekommission | Max. 2% z.G. des Vertreibers |
| Rücknahmekommission | Keine |
| Steuerstatus Deutschland | Investmentfonds gemäss InvStG |
| Minimale Erstinvestition | CHF 750'000 |
| Vermögensverwaltungsgebühr | 0.70% p.a. |
| Depotbankkommission | Max. 0.10% p.a. |
| Total Expense Ratio (TER) | 1.12% p.a. |

RISIKO- UND ERTRAGSPROFIL



Geringeres Risiko

Typischerweise geringere Rendite

Höheres Risiko

Typischerweise höhere Rendite

RECHTLICHE HINWEISE

Dieses Dokument ist für Marketing- und Informationszwecke. Es stellt in keiner Art und Weise ein Angebot dar oder soll auch nicht derart interpretiert werden, Wertschriften oder Anlageinstrumente zu kaufen oder zu verkaufen oder jedes andere Anlagegeschäft zu tätigen. Anteile des beschriebenen Anlagefonds, ENISO Systematic Risk (der "Fonds"), können nur auf der Basis der Informationen und Darstellungen angeboten werden, wie sie ausdrücklich im relevanten Prospekt mit integriertem Fondsvertrag dargelegt worden sind und auf keine andere Information oder Darstellung sollte ein Zusammenhang mit dem Angebot der Anteile abgestützt werden. Jede Anlage in den Fonds erfolgt auf der Grundlage des erwähnten Prospektes. Obwohl jede Anstrengung unternommen wurde, die Richtigkeit der hierin beschriebenen Informationen zu gewährleisten, sollte man sich nicht vollständig darauf berufen und keine Darstellungen, ausdrücklich oder implizit, erheben den Anspruch auf Vollständigkeit, Richtigkeit oder Aktualität der Informationen. Etwaige Unrichtigkeiten oder Unvollständigkeiten der Informationen begründen keine Haftung, weder für unmittelbare noch für mittelbare Schäden. Der Preis und der Wert der Anlagen sowie jegliches daraus resultierende Einkommen können schwanken. Die vergangene Entwicklung ist nicht zwingend eine Indikation für die zukünftige Entwicklung. Performance Daten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt. Zukünftige Renditen sind nicht garantiert und ein Verlust des ursprünglichen Kapitals kann erfolgen, inklusive eines permanenten, unwiederbringlichen Verlustes. Die hierin besprochenen Anlagen können für Anleger, je nach deren spezifischen Anlagezielen, Vermögensverhältnissen sowie der Gesetze ihrer Nationalität, ihres Wohnsitzes, Ort der amtlichen Eintragung oder Domizil ungeeignet sein. Anleger müssen jedes einzelne Anlageprodukt unabhängig in Zusammenhang mit ihrem eigenen Anlageziel, Risikoprofil, Umständen und Vermögensverhältnissen einschätzen und sachgemäss professionellen Rat einschliesslich steuerlicher Beratung suchen. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen sollen nicht die Finanz- und Anlageberatung oder einen anderen professionellen Ratschlag jeglicher Art ersetzen. Der Fonds verzichtet auf einen Vergleich mit einem Referenzindex. Anteile der in dieser Publikation erwähnten Anlagefonds dürfen innerhalb der USA weder angeboten noch verkauft oder ausgeliefert werden. Die rechtlichen Fondsdokumente sind unentgeltlich bei LLB Swiss Investment AG, Claridenstrasse 20, CH-8002 Zürich oder auf der Website www.llbsswiss.ch erhältlich.

TOP 5 POSITIONEN AKTIEN

| | |
|------------------|-------|
| NESTLE 'R' | 2.24% |
| RICHEMONT N | 2.20% |
| THE SWATCH GROUP | 2.19% |
| GIVAUDAN 'N' | 2.19% |
| SIKA | 2.18% |

TOP 5 POSITIONEN ANLEIHEN

| | |
|--|-------|
| SWISS RE ADMIN RE L 2016 1 3/8% 27/05/23 REG.S | 2.95% |
| TOYOTA 0.25% 09/04/24 | 2.41% |
| CONTINENTAL AG 2019 ZERO 12/09/23 REG.S | 2.34% |
| NORSK HYDRO 2019 1 1/8% 11/04/25 REG.S | 2.31% |
| MORGAN STANLEY 2015 1 3/4% 30/01/25 S-G | 2.02% |

STATISTIKEN

| | 1M | YTD | 1J | seit Auflage |
|---------------------|-------|--------|--------|--------------|
| Performance (eff.) | 0.46% | -6.04% | -4.66% | -3.78% |
| Rendite (p.a.) | | | | -0.71% |
| Volatilitaet (p.a.) | 2.62% | 12.81% | 10.14% | 6.43% |
| Sharpe Ratio | 1.97 | -0.76 | -0.44 | -0.11 |
| Max. Drawdown | 0.68% | 17.17% | 17.17% | 17.17% |

Steigende Nervosität

- Tiefe Zinsen, staatliche Unterstützungen und eine wieder höhere Beschäftigungsquote hellen düstere Stimmung auf
- Der Bondanteil litt unter dem leichten Spreadanstieg im Juli - Die Performance blieb aber vor derjenigen der Benchmark
- ENISO's Risk Appetite Indicator befindet sich schon fast auf der Nulllinie. Die Nervosität unter den Marktteilnehmern hat aufgrund steigender Coronavirus-Neuinfektionen und schwacher Wirtschaftsdaten zugenommen
- Der Fonds wies im Juli in EUR eine negative Wertentwicklung auf, vermochte aber nach Währungsabsicherung um knapp 0.9% zuzulegen