

AWI BVG 35 allegro

Quartalsbericht per 31. Dezember 2023

Übersicht

| | |
|---------------------------------|--------------------------------|
| Währung | CHF |
| ISIN | CH0002875646 |
| Valor | 287564 |
| Bloomberg-ID | AWIBVGL |
| Bewertungsintervall | täglich |
| Ausgabe/ Rücknahme von Anteilen | täglich bis 12.00 Uhr |
| Lancierungsdatum | 01.01.1984 |
| Benchmark | Customized Index, Total Return |

Anlagepolitik

Durch das Eingehen eines zu jedem Zeitpunkt als moderat zu bezeichnenden Risikos soll langfristig eine Rendite über dem BVG-Mindestzinssatz erwirtschaftet werden. Der gesamte Aktienanteil liegt hierfür zwischen minimal 25% und maximal 45%.

Die Anlagen der Anlagegruppe bestehen aus:

- min. 25% und max. 45% Aktien Inland und Ausland.
- min. 35% und max. 75% Obligationen in CHF und Fremdwährung.
- max. 30% Fremdwährungen (ohne Währungsabsicherung).
- max. 15% Immobilien.

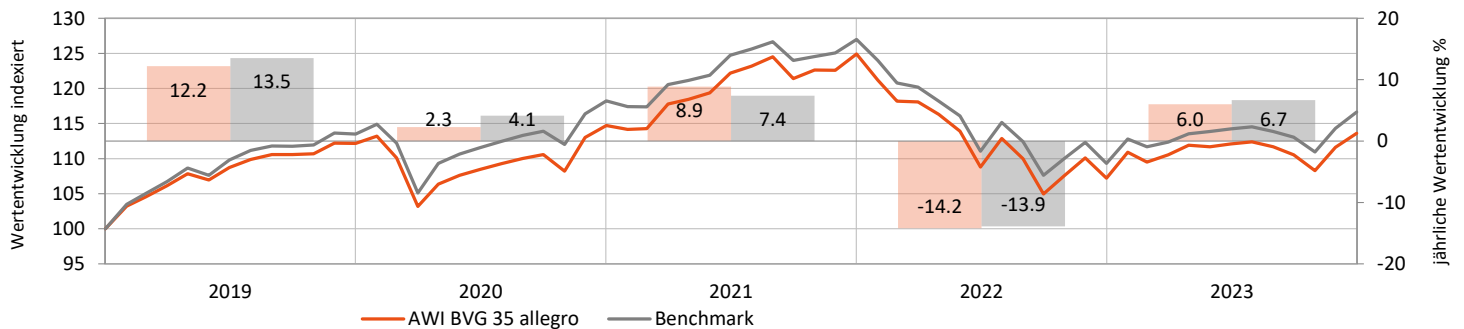
Eckdaten

| | |
|----------------------|-----------------|
| NAV (per 31.12.2023) | CHF 2'328.93 |
| Vermögen | CHF 148'673'826 |
| Ansprüche | 63'837.93 |
| Ausschüttung | thesaurierend |

Gebühren

| Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF) | < 20 | 20-30 | 30-100 | > 100 |
|------------------------------------|-------|-------|--------|-------|
| TER KGAST 2022 | 0.55% | 0.52% | 0.49% | 0.46% |
| Verwaltungsgebühr p.a. | 0.41% | 0.38% | 0.35% | 0.32% |

Wertentwicklung Netto (in CHF)



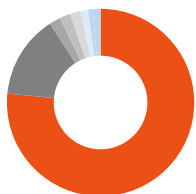
Performance

| in % | 1 Monat | 3 Monate | YTD | 1 Jahr | 3 Jahre p.a. | 5 Jahre p.a. | seit Auflage p.a. |
|--------------|---------|----------|------|--------|--------------|--------------|-------------------|
| Anlagegruppe | 1.80 | 2.80 | 5.99 | 5.99 | -0.32 | 2.58 | 4.83 |
| Benchmark | 2.03 | 3.17 | 6.68 | 6.68 | -0.45 | 3.12 | 4.98 |

Statistische Kennzahlen in %

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------------|--------------|-----------|
| Volatilität 1 Jahr | 5.87 | 5.40 |
| Volatilität 3 Jahre | 7.52 | 7.02 |
| Tracking Error 1 Jahr | 0.82 | |
| Tracking Error 3 Jahre | 0.94 | |
| Value at Risk (Konfidenzniveau 95%) | 2.73 | |
| Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%) | 1.02 | 1.24 |
| Korrelation 1 Jahr | 0.99 | 1.00 |

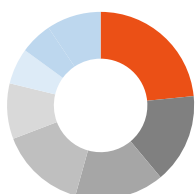
Regionen Allokation



| | |
|-------|------------------|
| 77.1% | Schweiz |
| 14.5% | Nord Amerika |
| 2.0% | Pazifik ex Japan |
| 1.9% | Euroland |
| 1.8% | Schwellenländer |
| 1.3% | Japan |
| 0.8% | Andere |
| 1.4% | Andere |

| | in % |
|------------------|-------|
| Schweiz | 77.14 |
| Nord Amerika | 14.53 |
| Pazifik ex Japan | 1.96 |
| Euroland | 1.87 |
| Schwellenländer | 1.84 |
| Japan | 1.30 |
| Andere | 1.35 |

Sektoren Allokation



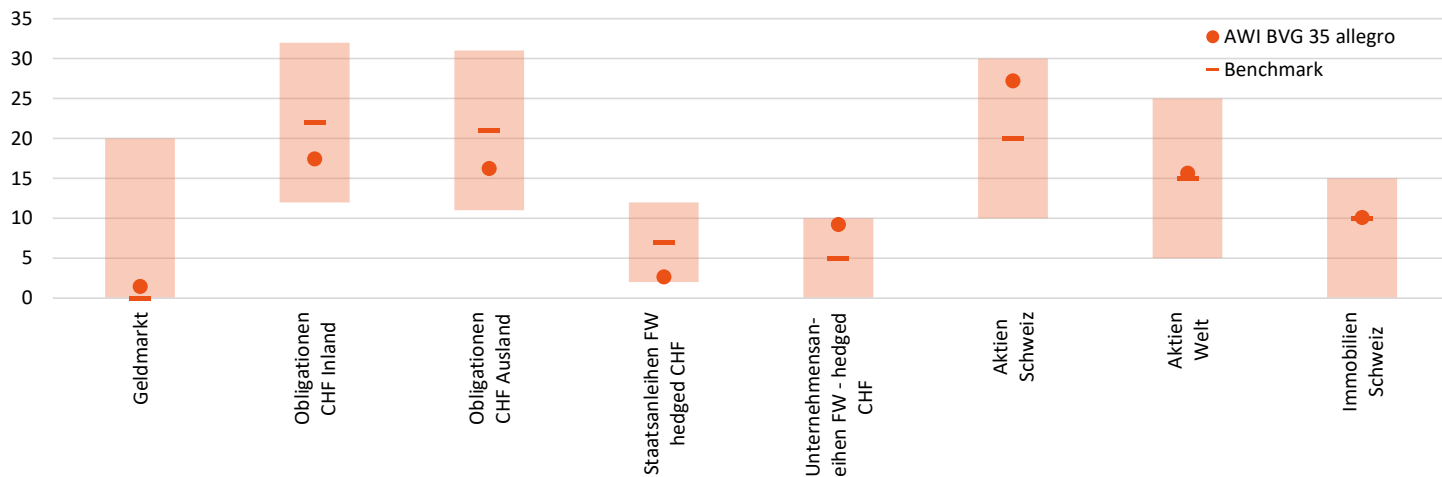
| | |
|-------|------------------|
| 23.4% | Gesundheit |
| 15.5% | Immobilien |
| 15.4% | Basiskonsumgüter |
| 14.9% | Finanz |
| 9.6% | Industrie |
| 6.2% | IT |
| 5.6% | Rohstoffe |
| 9.4% | Andere |

| | in % |
|------------------|-------|
| Gesundheit | 23.41 |
| Immobilien | 15.52 |
| Basiskonsumgüter | 15.42 |
| Finanz | 14.85 |
| Industrie | 9.60 |
| IT | 6.23 |
| Andere | 9.40 |

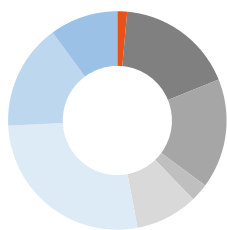
AWI BVG 35 allegro

Quartalsbericht per 31. Dezember 2023

Vermögensallokation

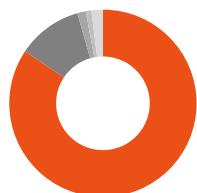


Vermögensallokation



| Anlagegruppe | Benchmark | Bandbreite |
|--------------------------------------|-----------|------------|
| Geldmarkt | 0.00 | 0-20% |
| Obligationen CHF Inland | 22.00 | 12-32% |
| Obligationen CHF Ausland | 21.00 | 11-31% |
| Staatsanleihen FW - hedged CHF | 7.00 | 2-12% |
| Unternehmensanleihen FW - hedged CHF | 5.00 | 0-10% |
| Aktien Schweiz | 20.00 | 10-30% |
| Aktien Welt | 15.00 | 5-25% |
| Immobilien Schweiz | 10.00 | 0-15% |

Währungsallokation (nach Absicherung)



| |
|-------------|
| 84.3% CHF |
| 11.3% USD |
| 1.4% EUR |
| 1.0% JPY |
| 2.0% Andere |

Die 5 grössten Beteiligungen

| Beteiligung | in % |
|---|------|
| Nestle | 4.82 |
| Novartis | 3.27 |
| Roche Holdings | 3.01 |
| CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS ETF b usd | 1.56 |
| UBS Group | 1.19 |

Rating Allokation



| |
|-----------|
| 35.5% AAA |
| 36.0% AA |
| 28.5% A |
| 0.0% BBB |

Die 5 grössten Schuldner

| Schuldner | in % |
|---|------|
| AXA WF - Global Buy and Maintain Credit | 9.23 |
| Pfandbriefbank CH | 4.62 |
| Pfandbriefzentrale CH | 3.80 |
| Schweizerische Eidgenossenschaft | 2.79 |
| USA | 0.94 |

Benchmarkzusammensetzung

| Benchmark | in % |
|---------------------------------------|-------|
| FTSE 3m Eurodeposit CHF | 0.00 |
| Swiss Bond Index Domestic AAA-BBB | 22.00 |
| Swiss Bond Index Foreign AAA-BBB | 21.00 |
| JPM GBI Curr-Hedged CHF | 7.00 |
| ICE BofAML Corporate Index hedged CHF | 5.00 |
| SPI Total Return | 20.00 |
| MSCI AC World ex CH net | 15.00 |
| SXI Real Estate Funds Broad | 10.00 |

Nur zur Informations- und Werbezwecken - Bitte lesen Sie die gesetzlich erforderlichen Fondsdokumente, bevor Sie eine endgültige Anlageentscheidung treffen. Dieses Dokument wurde von der 1741 Fund Solutions AG als Fondsleitung (nachfolgend «1741») mit grösster Sorgfalt erstellt. Die 1741 gibt jedoch keine Gewähr hinsichtlich dessen Inhalt und Vollständigkeit und lehnt jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung ergeben. Die hierin geäusserten Meinungen sind diejenigen der 1741 zum Erstellungszeitpunkt und können sich jederzeit unangekündigt ändern. Ist nichts anderes vermerkt, sind alle Zahlen ungeprüft. Dieses Dokument ist in Zusammenhang mit den gesetzlich erforderlichen Fondsdokumenten (Fondsvertrag sowie Jahresbericht und soweit anwendbar Prospekt, Basisinformationsblatt sowie Halbjahresbericht) (nachfolgend «Fondsdokumente») zu lesen, welche kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank des Fonds bezogen werden können. Eine Zeichnung von Anteilen wird nur auf der Grundlage der Fondsdokumente angenommen. Diese Marketinganzeige betrifft die Anteile des betreffenden Fonds und nicht eines Basiswerts, welcher vom Fonds erworben wird. Die Angaben in diesem Dokument dienen lediglich Informationszwecken und sind weder als Angebot, Empfehlung oder Anlageberatung aufzufassen. Es berücksichtigt keine spezifischen Bedürfnisse und entbindet den Empfänger nicht von seiner eigenen Beurteilung, allenfalls unter Beizug eines Beraters, die Informationen in Bezug auf die Vereinbarkeit mit seinen eigenen Verhältnissen, auf juristische, regulatorische, steuerliche und andere Konsequenzen zu prüfen. Die Anlagepolitik ist allenfalls nur in einer verkürzten Fassung wiedergegeben. Die vollständige Anlagepolitik inkl. aller Anlagebeschränkungen finden sich in den Fondsdokumenten. Der Fonds wird aktiv verwaltet. Mit jeder Anlage sind Risiken, insbesondere diejenigen von Wert- und Ertragschwankungen, verbunden. Bei Fremdwährungen besteht zusätzlich das Risiko, dass die Fremdwährung gegenüber der Referenzwährung des Anlegers an Wert verliert. Ein Totalverlust des investierten Betrages ist möglich. Umfassende Beschreibungen der Risiken sind den Fondsdokumenten zu entnehmen. Die dargestellte Wertentwicklung lässt bei Zeichnung, Umtausch und Rückgabe sowie dem Halten von Fondsanteilen allfällig anfallenden Kommissionen und Kosten unberücksichtigt, welche die Rendite der Anleger

reduzieren können. Angaben zum Nettoinventarwert (NAV) verstehen sich exklusive allfälliger Kommissionen. Es kann nicht garantiert werden, dass die Performance eines allfälligen Vergleichsindex erreicht oder übertroffen wird. Dieser Fonds ist in der Schweiz domiziliert. Der Vertrieb richtet sich ausdrücklich nicht an Personen, deren Nationalität oder Wohnsitz den Zugang zu solchen Informationen aufgrund der geltenden Gesetzgebung verbietet. Dieser Fonds ist nicht unter dem United States Securities Act von 1933 registriert. Nähere Informationen hierzu sowie zum öffentlichen Vertrieb in den einzelnen Ländern sind in den Fondsdokumenten zu finden. Alle Rechte vorbehalten.

Anlagestiftung Winterthur AWI, Bahnhofplatz 8, CH-8400 Winterthur, T +41 (0)52 202 02 30, F +41 (0)52 202 02 40, awi-anlagestiftung.ch