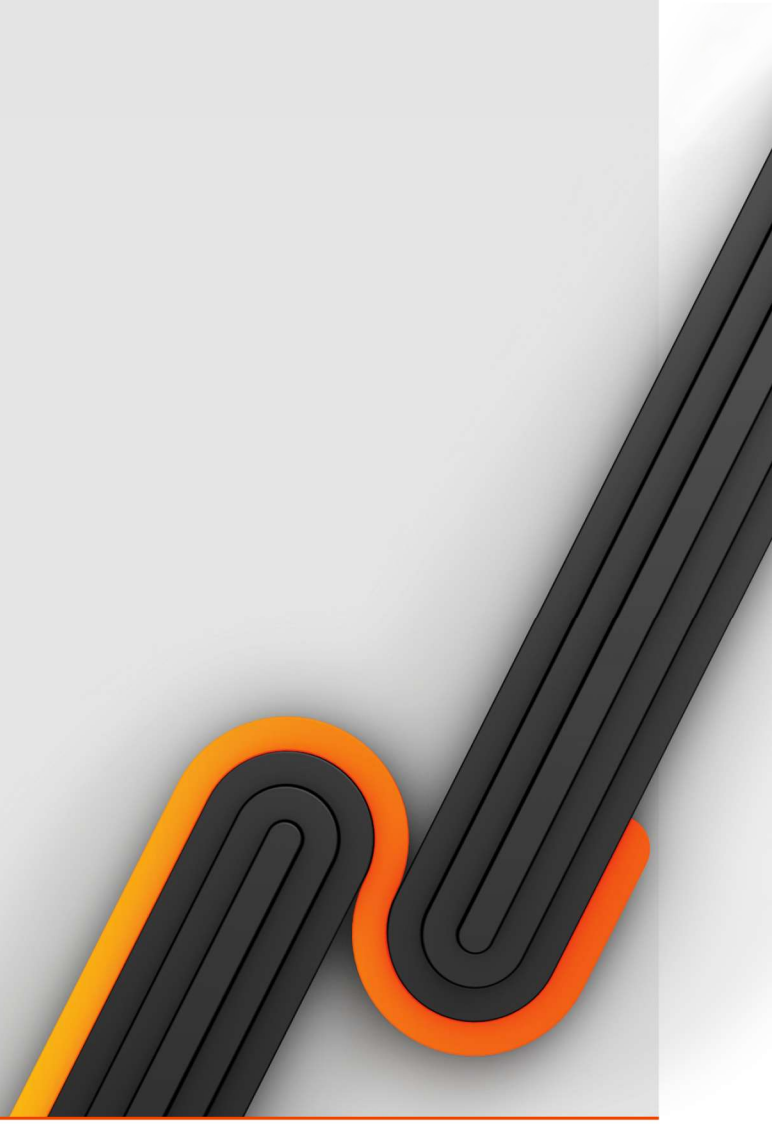
Quartalsbericht

per 31. Dezember 2020



Anlagestiftung Winterthur für Personalvorsorge (AWI), Bahnhofplatz 8, CH-8400 Winterthur,
Tel. +41 (0)52 202 02 30, Fax +41 (0)52 202 02 40, awi-anlagestiftung.ch

Inhaltsverzeichnis

Überblick 3

Kennzahlen per 31.12.2020 3
In eigener Sache 4

Aktive Anlagegruppen 5

AWI Obligationen Inland CHF 5
AWI Obligationen Inland CHF Redex 6
AWI Wohnbauhypotheken Schweiz 7
AWI Obligationen Ausland CHF 8
AWI Global Staatsanleihen 9
AWI Global Staatsanleihen Hedged CH 10
AWI Global SmartBeta Unternehmensanleihen Hedged CHF 11
AWI Aktien Schweiz SMC 12
AWI Global SmartBeta Aktien ESG 13
AWI BVG 25 andante 14
AWI BVG 35 allegro 15
AWI BVG 45 vivace 16

Alternative Anlagegruppen 17

AWI Insurance Linked Strategies 17
AWI KMU Darlehen CHF 18

Indexierte Anlagegruppen 19

AWI Aktien Schweiz, indexiert 19
AWI Aktien Europa ex CH, indexiert 20
AWI Aktien Japan, indexiert 21
AWI Aktien Emerging Markets, indexiert 22
AWI Welt ex CH, indexiert 23

Immobilien Anlagegruppen 24

AWI Immobilien Schweiz 24
AWI Immobilien Schweiz Indirekt 25

Ausweis gemäss Verordnung des EDI 26

Anzahl der gehaltenen Schuldner und Gesellschaften 29

Kontaktadresse 30

Überblick

Kennzahlen per 31.12.2020

Anlagegruppen	Valor	Währung	AuM [in Mio. CHF]	Inventar-wert	NAV Datum	Performance Ytd
Aktive Anlagegruppen						
AWI Obligationen Inland CHF	900453	CHF	76.71	1'187.70	31.12.2020	1.00%
AWI Obligationen Inland CHF Redex	20534023	CHF	20.25	966.94	31.12.2020	-0.25%
AWI Wohnbauhypotheken Schweiz	37991048	CHF	139.84	1'019.16	31.12.2020	0.12%
AWI Obligationen Ausland CHF	3635379	CHF	26.57	1'322.87	31.12.2020	0.10%
AWI Global Staatsanleihen	287593	CHF	25.77	1'421.69	31.12.2020	0.44%
AWI Global Staatsanleihen Hedged CHF	22342396	CHF	16.43	1'028.00	31.12.2020	3.45%
AWI Global SmartBeta Unternehmensanleihen Hedged CHF	23093367	CHF	203.57	1'222.62	31.12.2020	6.48%
AWI Aktien Schweiz SMC	1807765	CHF	127.52	5'434.33	31.12.2020	12.82%
AWI Global SmartBeta Aktien ESG	24760880	CHF	41.30	1'685.02	31.12.2020	1.33%
AWI BVG 25 andante	900434	CHF	14.15	1'667.25	31.12.2020	2.04%
AWI BVG 35 allegro	287564	CHF	232.68	2'351.59	31.12.2020	2.26%
AWI BVG 45 vivace	900450	CHF	31.63	1'825.40	31.12.2020	2.38%
Alternative Anlagegruppen						
AWI Insurance Linked Strategies	30177090	USD	139.62	1'132.62	31.12.2020	4.66%
AWI KMU Darlehen CHF	48824031	CHF	42.96	1'031.41	31.12.2020	1.28%
Indexierte Anlagegruppen						
AWI Aktien Schweiz, indexiert	441473	CHF	73.01	4'559.91	31.12.2020	3.46%
AWI Aktien Europa ex CH, indexiert	441474	CHF	5.42	2'749.46	31.12.2020	-4.88%
AWI Aktien Japan, indexiert	441476	CHF	49.61	1'075.71	31.12.2020	4.17%
AWI Aktien Emerging Markets, indexiert	441477	CHF	90.43	3'130.41	31.12.2020	5.19%
AWI Aktien Welt ex CH, indexiert	1767724	CHF	50.00	2'412.32	31.12.2020	7.67%
Immobilien Anlagegruppen						
AWI Immobilien Schweiz	4735240	CHF	97.89	1'160.32	31.12.2020	4.24%
AWI Immobilien Schweiz Indirekt	28507912	CHF	34.96	1'393.29	31.12.2020	5.29%

In eigener Sache

Sehr geehrte Anleger

Sehr geehrte Interessenten

Wir wünschen Ihnen einen erfolgreichen und gesunden Start ins neue Jahr 2021!

AWI Insurance Linked Strategies (ILS)

Nutzen Sie diese aktuelle und attraktive Anlagelösung und diversifizieren Sie gleichzeitig Ihre Anlagen um die Abhängigkeit von herkömmlichen Anlageklassen zu reduzieren.

Der nächste Zeichnungstermin ist der **15. Januar 2021**:

Für zusätzliche Angaben stehen wir gerne zur Verfügung und freuen uns auch im neuen Jahr auf persönliche Gespräche mit Ihnen.

Ihre AWI – Von Pensionskassen für Pensionskassen

Jean-Claude Scherz
Geschäftsleiter

Urs Brügger
Geschäftsleiter

Michael Zuppiger
Geschäftsleiter,
Leiter Marktbearbeitung

AWI Obligationen Inland CHF

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0009004539
Valor	900453
Bloomberg-ID	AWIOBSW
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12.00 Uhr
Lancierungsdatum	01.11.1999
Benchmark	SBI Domestic AAA-BBB Total Return

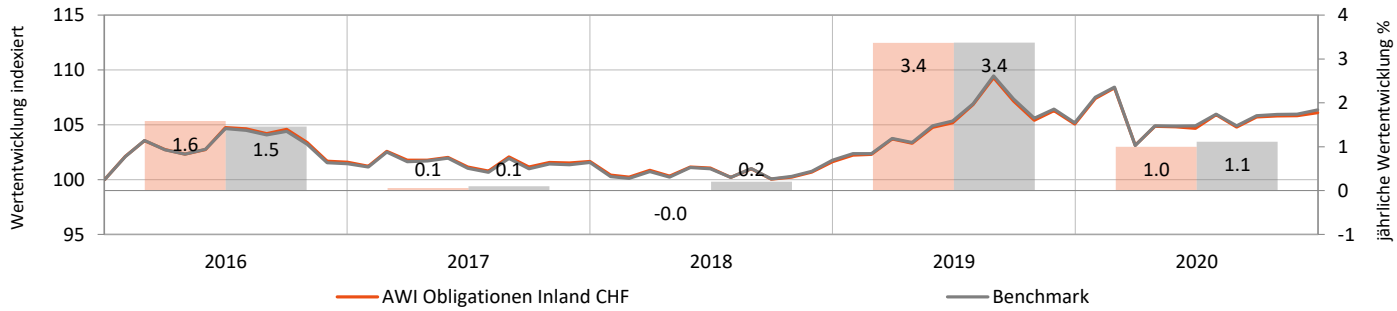
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'187.70	CHF 1'175.94
Vermögen	CHF 76'711'093	CHF 85'787'603
Ansprüche	64'587.76	72'952.52
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.25%	0.23%	0.20%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.22%	0.20%	0.17%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.37	1.00	1.00	4.40	6.11	24.89	84.74
Benchmark	0.50	1.11	1.11	4.73	6.36	25.62	88.38

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	1.00	1.44	1.19	2.25	2.94
Benchmark	1.11	1.55	1.24	2.30	3.03

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	1.58	0.06	-0.01	3.37	1.00
Benchmark	1.46	0.10	0.20	3.37	1.11

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	6.05	4.53	4.17	3.58	3.42
Volatilität Benchmark	6.09	4.56	4.18	3.58	3.43
Tracking Error	0.30	0.22	0.20	0.26	0.38
Tracking Error (ex ante)	0.21				
Information Ratio	-0.38	-0.49	-0.24	-0.23	-0.25
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.16	0.32	0.29	0.63	0.86
Beta-Faktor	0.92	0.97	0.98	0.99	0.99
Jensen Alpha	-0.02	-0.06	-0.02	-0.03	-0.05
Maximum Drawdown	-4.83	-5.64	-5.64	-5.64	-5.64
Recovery Periode (in Monaten)*	2.00	8.00	8	8	(16)
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	2.82	2.11	1.94	1.67	1.59

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Obligationen Inland CHF Redex

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0205340232
Valor	20534023
Bloomberg-ID	AWIORDX
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	jeweils am Donnerstag bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	11.07.2013
Benchmark	keine

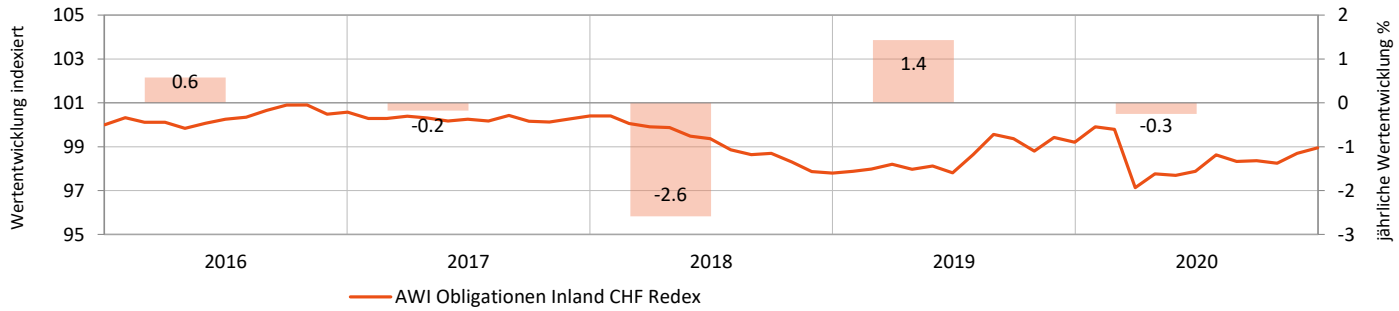
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 966.94	CHF 969.40
Vermögen	CHF 20'256'682	CHF 20'308'176
Ansprüche	20'949.23	20'949.23
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.35%	0.33%	0.30%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.27%	0.25%	0.22%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.60	-0.25	-0.25	-1.45	-1.05	-	-3.31
kein Benchmark	-	-	-	-	-	-	-

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	-0.25	-0.48	-0.21	-	-0.45
kein Benchmark	-	-	-	-	-

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	0.58	-0.18	-2.59	1.43	-0.25
kein Benchmark	-	-	-	-	-

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	3.02	2.06	1.65	-	1.63
Volatilität Benchmark	-	-	-	-	-
Tracking Error	-	-	-	-	-
Tracking Error (ex ante)	-				
Information Ratio	-	-	-	-	-
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	-0.08	-0.24	-0.13	-	-0.27
Beta-Faktor	-	-	-	-	-
Jensen Alpha	-	-	-	-	-
Maximum Drawdown	-2.78	-3.26	-3.84	-	-5.24
Recovery Periode (in Monaten)*	3.00	27.00	7	-	(89)
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	1.41	0.96	0.77	-	0.76

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Wohnbauhypotheken Schweiz

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0379910489
Valor	37991048
Bloomberg-ID	keine
Bewertungsintervall	monatlich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	siehe Gebührenreglement
Lancierungsdatum	29.03.2018
Benchmark	SBI Domestic AAA-BBB 5-7Y (TR)

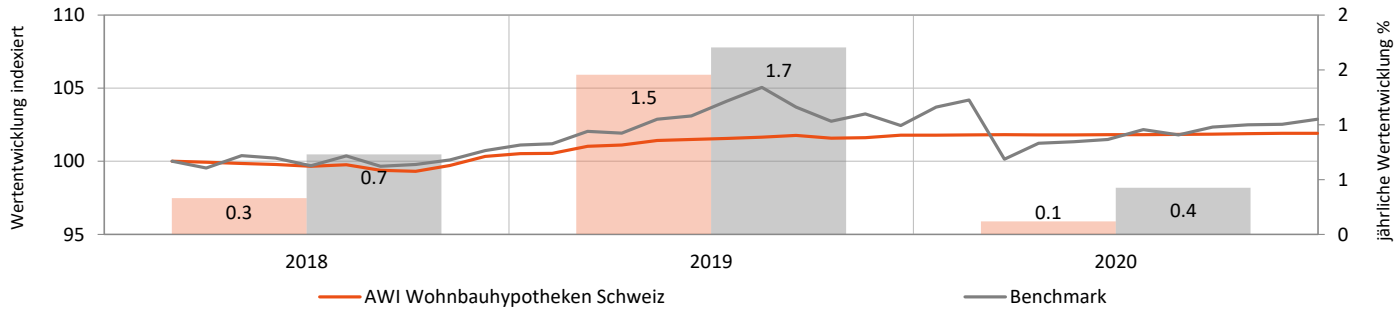
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'019.16	CHF 1'017.94
Vermögen	CHF 139'843'057	CHF 92'679'807
Ansprüche	137'213.37	91'046.72
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.40%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.36%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.05	0.12	0.12	-	-	-	1.92
Benchmark	0.53	0.43	0.43	-	-	-	2.88

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.12	-	-	-	0.69
Benchmark	0.42	-	-	-	1.03

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	-	-	0.33	1.46	0.12
Benchmark	-	-	0.73	1.70	0.43

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	0.17	-	-	-	0.64
Volatilität Benchmark	4.42	-	-	-	3.26
Tracking Error	4.48	-	-	-	3.16
Tracking Error (ex ante)	1.47				
Information Ratio	-0.07	-	-	-	-0.11
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.71	-	-	-	1.07
Beta-Faktor	-0.01	-	-	-	0.05
Jensen Alpha	0.12	-	-	-	0.64
Maximum Drawdown	-0.03	-	-	-	-0.68
Recovery Periode (in Monaten)*	3.00	(0)	(0)	(0)	2
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	0.08	-	-	-	0.30

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Obligationen Ausland CHF

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0036353792
Valor	3635379
Bloomberg-ID	AWIOBAC
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	01.01.2008
Benchmark	SBI Foreign AAA-BBB Total Return

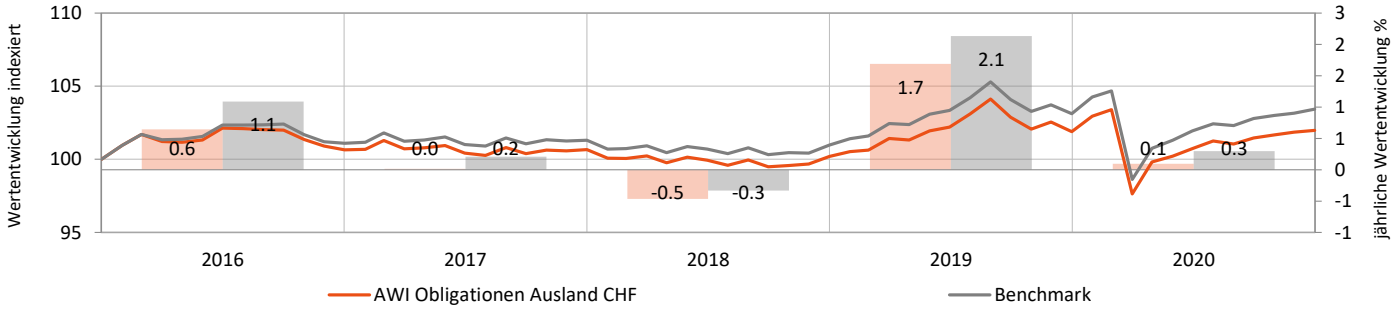
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'322.87	CHF 1'321.59
Vermögen	CHF 26'570'035	CHF 39'575'687
Ansprüche	20'085.15	29'945.55
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.28%	0.26%	0.23%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.22%	0.20%	0.17%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.52	0.10	0.10	1.32	1.98	17.95	32.29
Benchmark	0.63	0.30	0.30	2.10	3.43	19.77	33.92

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.10	0.44	0.39	1.66	2.17
Benchmark	0.30	0.70	0.68	1.82	2.27

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	0.64	0.01	-0.46	1.69	0.10
Benchmark	1.09	0.21	-0.33	2.13	0.30

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	6.23	3.89	3.20	2.64	2.66
Volatilität Benchmark	6.40	3.99	3.28	2.71	2.83
Tracking Error	0.34	0.24	0.23	0.29	0.56
Tracking Error (ex ante)	0.27				
Information Ratio	-0.60	-1.08	-1.26	-0.54	-0.17
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.02	0.11	0.12	0.63	0.82
Beta-Faktor	0.90	0.95	0.96	0.96	0.92
Jensen Alpha	-0.17	-0.22	-0.25	-0.08	0.09
Maximum Drawdown	-5.58	-6.23	-6.23	-26.60	-6.23
Recovery Periode (in Monaten)*	5.00	11.00	11	9	(16)
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	2.90	1.81	1.49	1.23	1.24

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Global Staatsanleihen

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0002875935
Valor	287593
Bloomberg-ID	AWIGLOB
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	15.07.1992
Benchmark	FTSE World Government Bond Index ex CH Total Return, in CHF

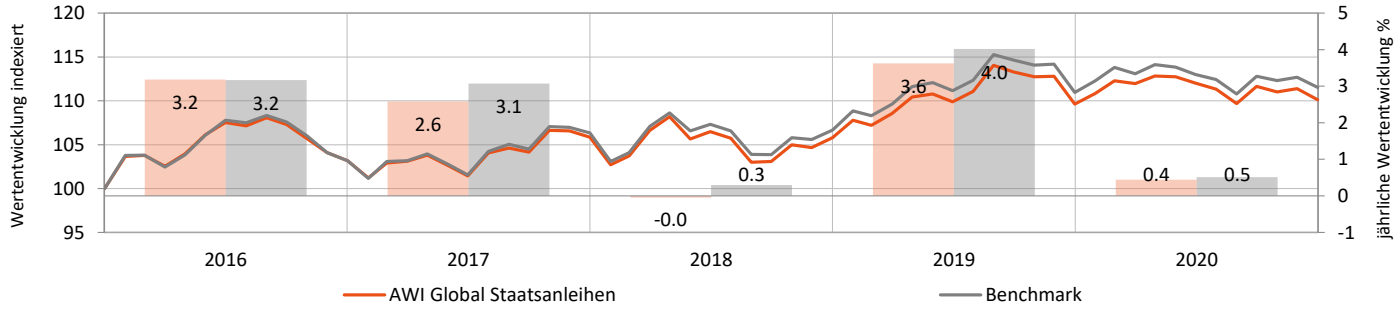
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'421.69	CHF 1'415.45
Vermögen	CHF 25'773'028	CHF 25'659'838
Ansprüche	18'128.45	18'128.45
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	> 30
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.43%	0.41%	0.36%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.37%	0.35%	0.30%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	-1.38	0.44	0.44	4.03	10.11	15.92	173.65
Benchmark	-1.13	0.51	0.51	4.88	11.52	19.24	161.82

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.44	1.32	1.94	1.49	3.59
Benchmark	0.51	1.60	2.20	1.77	3.43

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	3.18	2.58	-0.05	3.62	0.44
Benchmark	3.17	3.07	0.30	4.02	0.51

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	4.36	5.01	5.09	7.71	7.87
Volatilität Benchmark	4.46	4.99	5.16	7.63	7.86
Tracking Error	0.53	0.44	0.43	0.70	1.13
Tracking Error (ex ante)	0.34				
Information Ratio	-0.13	-0.62	-0.60	-0.41	0.14
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.10	0.26	0.38	0.19	0.46
Beta-Faktor	0.90	0.97	0.97	1.00	0.99
Jensen Alpha	-0.02	-0.23	-0.19	-0.28	0.21
Maximum Drawdown	-2.78	-4.79	-10.73	-21.00	-21.29
Recovery Periode (in Monaten)*	5.00	6.00	8	93	108
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	2.03	2.33	2.37	3.59	3.66

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Global Staatsanleihen Hedged CHF

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0223423960
Valor	22342396
Bloomberg-ID	AWIGLOH
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	02.12.2019
Benchmark	FTSE World Government Bond Index ex CH Total Return,

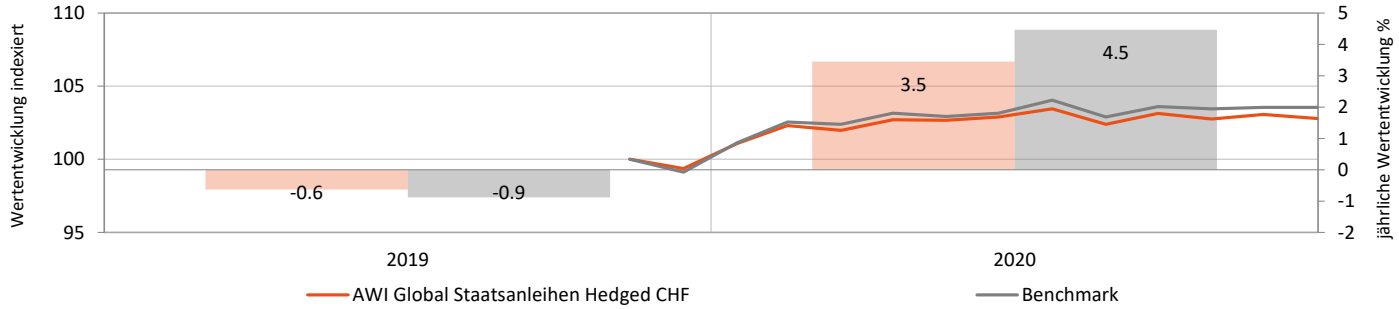
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'028.00	CHF 993.69
Vermögen	CHF 16'437'722	CHF 15'889'094
Ansprüche	15'990.00	15'990.00
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	> 30
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.45%	0.43%	0.38%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.37%	0.35%	0.30%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	-0.32	3.45	3.45	-	-	-	2.80
Benchmark	-0.05	4.47	4.47	-	-	-	-

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	3.44	-	-	-	2.57
Benchmark	4.46	-	-	-	-

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	-	-	-	-0.63	3.45
Benchmark	-	-	-	-0.88	4.47

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	2.67	-	-	-	2.67
Volatilität Benchmark	3.00	-	-	-	3.00
Tracking Error	0.71	-	-	-	0.71
Tracking Error (ex ante)	0.73				
Information Ratio	-1.43	-	-	-	-
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	1.29	-	-	-	0.96
Beta-Faktor	0.80	-	-	-	0.80
Jensen Alpha	-0.12	-	-	-	-
Maximum Drawdown	-1.03	-	-5.87	-	-5.87
Recovery Periode (in Monaten)*	2.00	-	7	-	7
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	1.24	-	-	-	1.24

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Global SmartBeta Unternehmensanleihen Hedged CHF

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0230933670
Valor	23093367
Bloomberg-ID	AWIGSBI
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	31.01.2014
Universum	ICE BofAML Global Corporate Hedged CHF

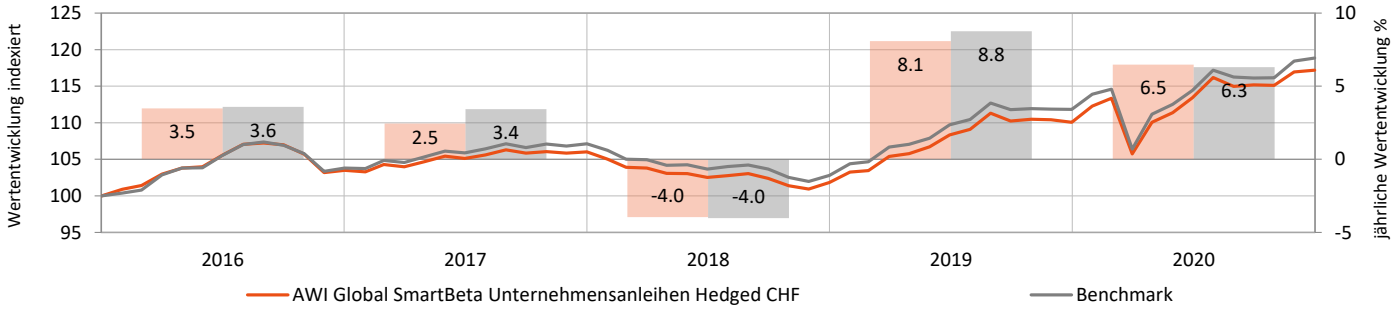
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'222.62	CHF 1'148.22
Vermögen	CHF 203'579'745	CHF 173'384'216
Ansprüche	166'510.44	151'002.44
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-50	> 50
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.28%	0.27%	0.26%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.18%	0.17%	0.16%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	1.74	6.48	6.48	10.54	17.19	-	22.26
Benchmark	2.35	6.30	6.30	10.93	18.85	-	23.33

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	6.46	3.39	3.22	-	2.95
Benchmark	6.28	3.51	3.51	-	3.08

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	3.48	2.45	-3.95	8.09	6.48
Benchmark	3.58	3.43	-4.03	8.76	6.30

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	8.84	5.71	4.82	-	4.44
Volatilität Benchmark	9.32	5.98	5.05	-	4.60
Tracking Error	0.97	0.61	0.64	-	0.61
Tracking Error (ex ante)	0.95				
Information Ratio	0.19	-0.20	-0.46	-	-0.21
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.73	0.59	0.67	-	0.66
Beta-Faktor	0.87	0.92	0.93	-	0.94
Jensen Alpha	0.99	0.15	-0.05	-	0.04
Maximum Drawdown	-6.70	-6.70	-6.70	-	-6.70
Recovery Periode (in Monaten)*	3.00	3.00	3	(0)	3
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	4.11	2.66	2.24	-	2.07

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Aktien Schweiz SMC

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0018077658
Valor	1807765
Bloomberg-ID	AWIAKSC
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	01.04.2004
Benchmark	SPI Extra Total Return (SPI ex SLI bis 30.9.2020)

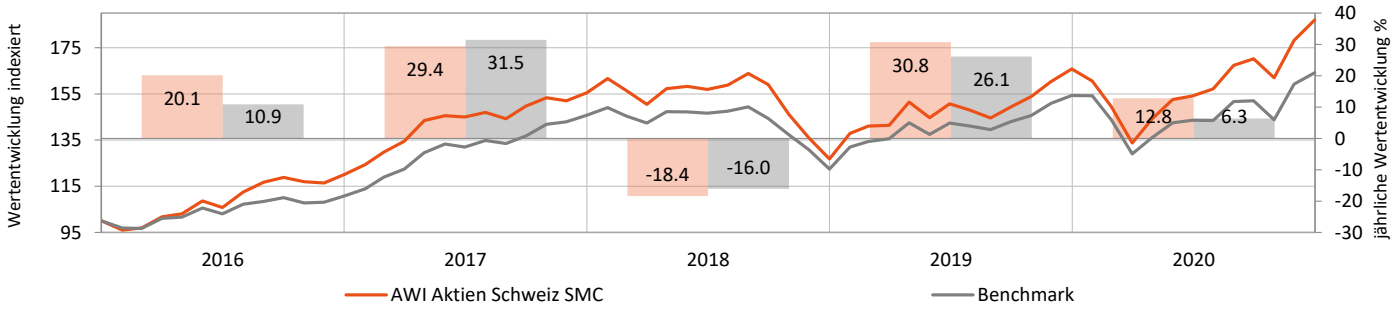
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 5'434.33	CHF 4'816.87
Vermögen	CHF 127'523'790	CHF 114'965'242
Ansprüche	23'466.33	23'867.20
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	30-50	50-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.80%	0.75%	0.70%	0.67%	0.64%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.76%	0.71%	0.66%	0.63%	0.60%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	9.93	12.82	12.82	20.31	87.05	155.44	443.43
Benchmark	7.99	6.35	6.35	12.60	64.16	140.37	352.84

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	12.78	6.35	13.33	9.82	10.62
Benchmark	6.33	4.03	10.41	9.16	9.43

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	20.13	29.42	-18.45	30.76	12.82
Benchmark	10.88	31.49	-16.04	26.10	6.35

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	21.16	17.49	15.00	14.33	13.98
Volatilität Benchmark	19.69	14.84	12.70	12.10	12.09
Tracking Error	4.95	4.71	4.42	4.35	4.53
Tracking Error (ex ante)	4.18				
Information Ratio	1.30	0.49	0.66	0.15	0.26
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.60	0.36	0.89	0.69	0.76
Beta-Faktor	0.97	1.11	1.12	1.13	1.09
Jensen Alpha	6.67	1.86	1.69	-0.50	0.35
Maximum Drawdown	-16.72	-22.60	-22.60	-27.57	-57.40
Recovery Periode (in Monaten)*	6.00	8.00	8	24	59
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	9.84	8.14	6.98	6.67	6.50

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Global SmartBeta Aktien ESG

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0247608802
Valor	24760880
Bloomberg-ID	AWGSAHC
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	30.09.2014
Universum**	MSCI World ex CH Total Return Net Index, in CHF

Eckdaten

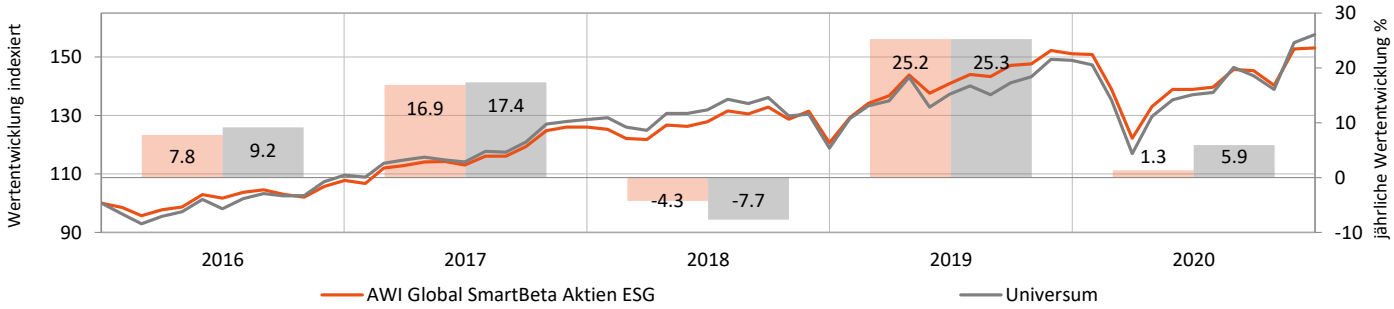
	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'685.02	CHF 1'662.85
Vermögen	CHF 41'309'193	CHF 38'164'209
Ansprüche	24'515.57	22'951.05
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

*** MSCI World Total Return Net Index, in CHF bis 31.1.2018*

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-50	> 50
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.26%	0.25%	0.24%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.20%	0.19%	0.18%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	5.39	1.33	1.33	21.51	53.09	-	68.50
Universum	9.83	5.92	5.92	22.54	57.64	-	64.63

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	1.33	6.70	8.88	-	8.58
Universum	5.91	7.01	9.52	-	8.18

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	7.78	16.90	-4.26	25.25	1.33
Universum	9.16	17.36	-7.67	25.27	5.92

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	20.38	14.88	12.53	-	13.32
Volatilität Benchmark	23.94	17.55	14.83	-	15.39
Tracking Error	4.65	4.06	3.71	-	3.64
Tracking Error (ex ante)	5.65				
Information Ratio	-0.98	-0.07	-0.17	-	0.11
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.07	0.45	0.71	-	0.64
Beta-Faktor	0.78	0.81	0.81	-	0.83
Jensen Alpha	-3.27	1.03	1.15	-	1.75
Maximum Drawdown	-18.98	-19.72	-19.72	-	-19.72
Recovery Periode (in Monaten)*	7.00	9.00	9	(0)	11
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	9.48	6.92	5.83	-	6.20

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI BVG 25 andante

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0009004349
Valor	900434
Bloomberg-ID	AWIBVGA
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12.00 Uhr
Lancierungsdatum	01.11.1999
Benchmark	Customized Index, Total Return

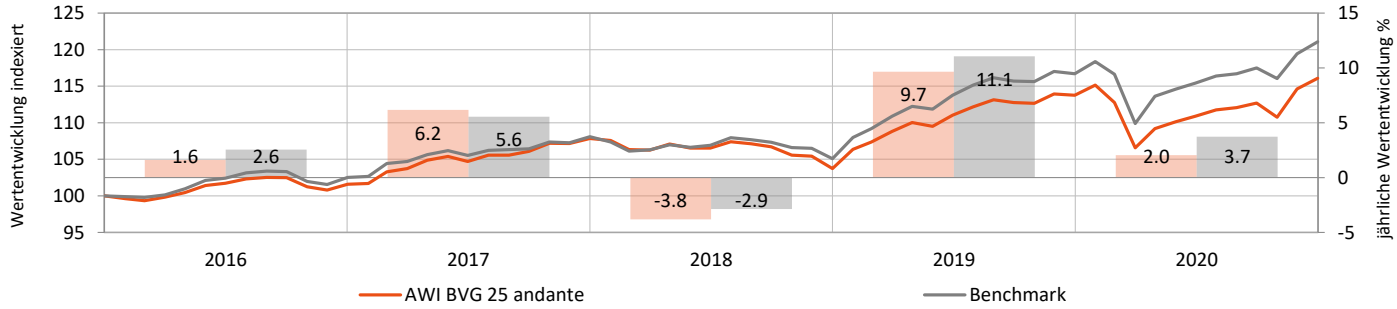
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'667.25	CHF 1'633.95
Vermögen	CHF 14'153'464	CHF 15'306'352
Ansprüche	8'489.13	9'367.71
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	30-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.56%	0.53%	0.50%	0.47%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.36%	0.33%	0.30%	0.27%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	3.00	2.04	2.04	7.63	16.09	42.89	79.53
Benchmark	3.04	3.74	3.74	12.03	21.07	55.74	119.58

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	2.03	2.48	3.03	3.63	2.80
Benchmark	3.73	3.85	3.89	4.53	3.78

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	1.60	6.16	-3.81	9.66	2.04
Benchmark	2.56	5.55	-2.86	11.07	3.74

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	7.78	5.22	4.33	3.87	3.98
Volatilität Benchmark	7.90	5.33	4.40	3.88	4.02
Tracking Error	1.32	0.89	0.79	0.91	0.96
Tracking Error (ex ante)	1.47				
Information Ratio	-1.28	-1.54	-1.10	-0.99	-1.02
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.26	0.47	0.70	0.94	0.70
Beta-Faktor	0.90	0.94	0.95	0.96	0.95
Jensen Alpha	-1.31	-1.15	-0.68	-0.73	-0.80
Maximum Drawdown	-7.43	-7.43	-7.43	-7.43	-13.67
Recovery Periode (in Monaten)*	8.00	8.00	8	8	13
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	3.62	2.43	2.02	1.80	1.85

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI BVG 35 allegro

Eckdaten

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

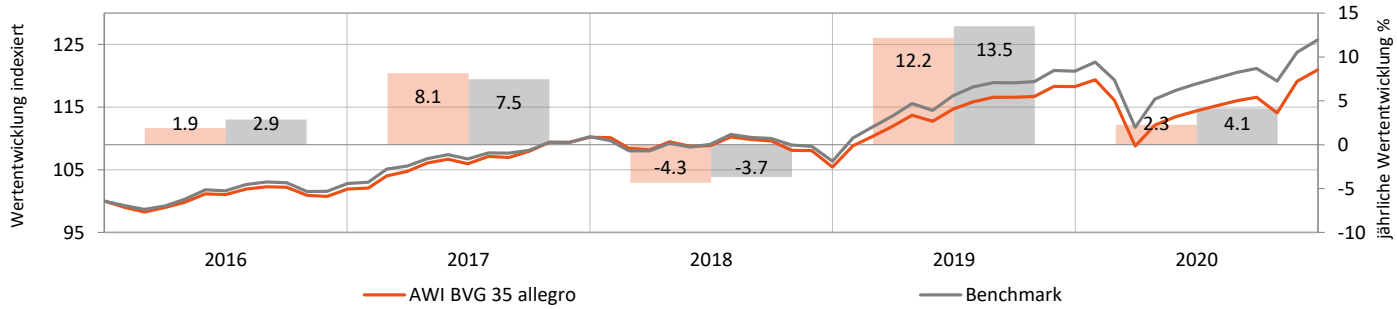
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 2'351.59	CHF 2'299.56
Vermögen	CHF 232'689'704	CHF 249'205'286
Ansprüche	98'950.07	108'370.96
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	30-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.54%	0.51%	0.48%	0.45%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.41%	0.38%	0.35%	0.32%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	3.74	2.26	2.26	9.75	20.94	52.90	567.56
Benchmark	3.78	4.15	4.15	14.04	25.73	66.68	609.20

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	2.26	3.15	3.87	4.33	5.26
Benchmark	4.14	4.47	4.68	5.24	5.43

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	1.90	8.15	-4.34	12.18	2.26
Benchmark	2.86	7.45	-3.66	13.51	4.15

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	9.31	6.38	5.32	4.79	4.99
Volatilität Benchmark	9.25	6.42	5.32	4.79	5.01
Tracking Error	1.21	0.87	0.79	0.89	0.97
Tracking Error (ex ante)	1.40				
Information Ratio	-1.55	-1.53	-1.03	-1.02	-0.18
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.24	0.49	0.73	0.90	1.05
Beta-Faktor	0.92	0.96	0.97	0.98	0.97
Jensen Alpha	-1.55	-1.14	-0.68	-0.78	-0.02
Maximum Drawdown	-8.85	-8.85	-8.85	-8.85	-19.61
Recovery Periode (in Monaten)*	8.00	8.00	8	8	36
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	4.33	2.97	2.47	2.23	2.32

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI BVG 45 vivace

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0009004505
Valor	900450
Bloomberg-ID	AWIBVGV
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12.00 Uhr
Lancierungsdatum	01.11.1999
Benchmark	Customized Index, Total Return

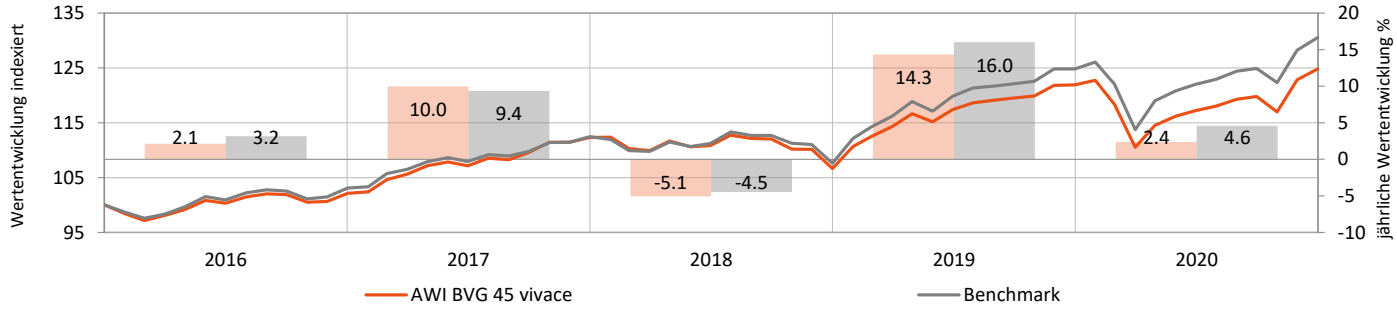
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'825.40	CHF 1'783.05
Vermögen	CHF 31'637'233	CHF 30'725'488
Ansprüche	17'331.71	17'231.98
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	30-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.59%	0.56%	0.53%	0.50%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.46%	0.43%	0.40%	0.37%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	4.18	2.38	2.38	11.11	24.81	61.66	91.31
Benchmark	4.50	4.58	4.58	16.08	30.54	78.25	130.92

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	2.37	3.57	4.53	4.92	3.11
Benchmark	4.56	5.09	5.47	5.95	4.03

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	2.13	9.98	-5.06	14.32	2.38
Benchmark	3.15	9.37	-4.48	16.01	4.58

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	10.35	7.32	6.16	5.70	5.99
Volatilität Benchmark	10.66	7.60	6.34	5.80	6.11
Tracking Error	1.09	0.87	0.80	0.93	1.06
Tracking Error (ex ante)	0.76				
Information Ratio	-2.02	-1.74	-1.18	-1.11	-0.87
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.23	0.49	0.73	0.86	0.52
Beta-Faktor	0.89	0.93	0.95	0.96	0.96
Jensen Alpha	-1.70	-1.17	-0.66	-0.80	-0.75
Maximum Drawdown	-9.94	-9.94	-9.94	-9.94	-25.60
Recovery Periode (in Monaten)*	8.00	8.00	8	8	46
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	4.81	3.41	2.87	2.65	2.79

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Insurance Linked Strategies

Eckdaten

Übersicht

Währung	USD
ISIN	CH0301770902
Valor	30177090
Bloomberg-ID	AWILSAU
Bewertungsintervall	monatlich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	siehe Gebührenreglement
Lancierungsdatum	15.12.2015
Benchmark	keine

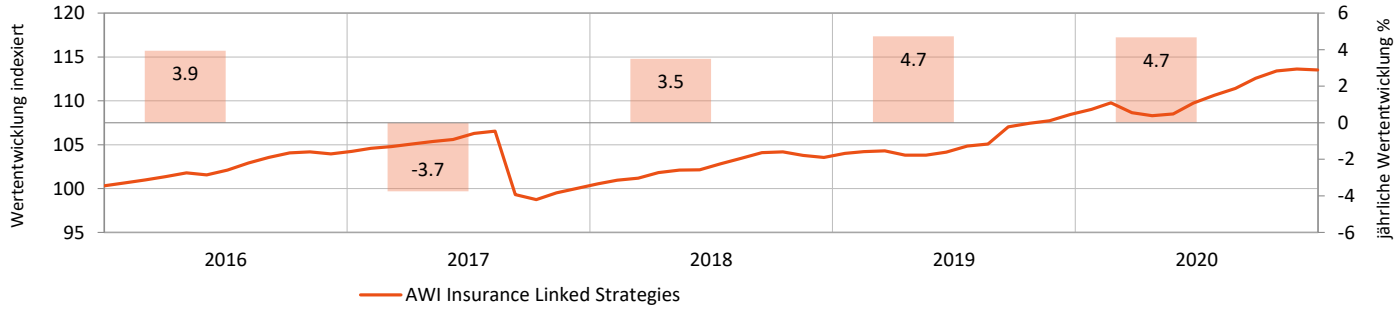
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	USD 1'132.62	USD 1'082.01
Vermögen	USD 139'619'425	USD 114'857'083
Ansprüche	123'271.24	106'152.03
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. USD)	< 5	5-20	> 20
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	1.36%	1.21%	1.16%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	1.25%	1.10%	1.05%

Wertentwicklung Netto (in USD)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.84	4.68	4.68	13.47	13.52	-	13.32
kein Benchmark	-	-	-	-	-	-	-

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	4.66	4.30	2.57	-	2.49
kein Benchmark	-	-	-	-	-

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	3.94	-3.75	3.50	4.73	4.68
kein Benchmark	-	-	-	-	-

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	2.09	1.75	3.53	-	3.53
Volatilität Benchmark	-	-	-	-	-
Tracking Error	-	-	-	-	-
Tracking Error (ex ante)	-				
Information Ratio	-	-	-	-	-
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	2.24	2.46	0.73	-	0.70
Beta-Faktor	-	-	-	-	-
Jensen Alpha	-	-	-	-	-
Maximum Drawdown	-1.33	-1.33	-7.32	-	-7.32
Recovery Periode (in Monaten)*	4.00	4.00	14	-	24
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	0.97	0.81	1.64	-	1.64

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI KMU Darlehen CHF

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0488240315
Valor	48824031
Bloomberg-ID	AWKDCHF
Bewertungsintervall	monatlich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	siehe Gebührenreglement
Lancierungsdatum	31.07.2019
Benchmark	keine

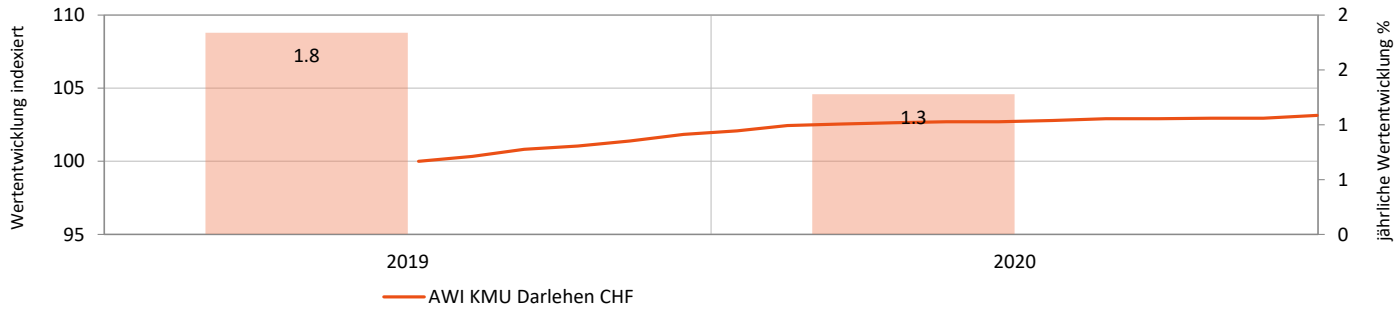
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'031.41	CHF 1'018.38
Vermögen	CHF 42'956'766	CHF 18'490'803
Ansprüche	41'648.66	18'157.05
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.55%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.55%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	0.22	1.28	1.28	-	-	-	3.14
kein Benchmark	-	-	-	-	-	-	-

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	1.28	-	-	-	2.20
kein Benchmark	-	-	-	-	-

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	-	-	-	1.84	1.28
kein Benchmark	-	-	-	-	-

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	0.48	-	-	-	0.55
Volatilität Benchmark	-	-	-	-	-
Tracking Error	-	-	-	-	-
Tracking Error (ex ante)	-				
Information Ratio	-	-	-	-	-
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	2.64	-	-	-	3.99
Beta-Faktor	-	-	-	-	-
Jensen Alpha	-	-	-	-	-
Maximum Drawdown	-	-	-	-	-
Recovery Periode (in Monaten)*	(0)	(0)	(0)	(0)	(0)
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	0.22	-	-	-	0.26

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Aktien Schweiz, indexiert

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0004414733
Valor	441473
Bloomberg-ID	AWISCHW
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	02.05.1996
Benchmark	SPI Total Return

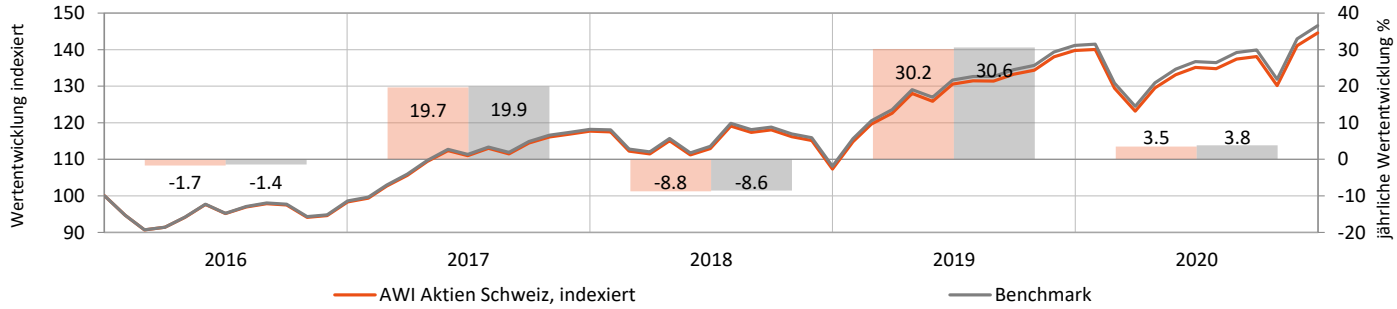
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 4'559.91	CHF 4'407.36
Vermögen	CHF 73'013'228	CHF 74'783'732
Ansprüche	16'011.99	16'967.92
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 30	30-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.28%	0.26%	0.18%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.27%	0.25%	0.17%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	4.67	3.46	3.46	22.85	44.58	123.03	388.21
Benchmark	4.74	3.82	3.82	23.96	46.56	130.16	439.10

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	3.45	7.09	7.64	8.34	6.63
Benchmark	3.81	7.42	7.94	8.69	7.06

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	-1.67	19.68	-8.78	30.17	3.46
Benchmark	-1.41	19.92	-8.57	30.59	3.82

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	15.17	12.43	11.14	11.32	12.02
Volatilität Benchmark	15.21	12.46	11.17	11.35	12.03
Tracking Error	0.08	0.06	0.07	0.12	0.65
Tracking Error (ex ante)	0.03				
Information Ratio	-4.61	-5.79	-4.22	-2.81	-0.66
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.23	0.57	0.69	0.74	0.55
Beta-Faktor	0.92	0.97	0.98	0.99	0.99
Jensen Alpha	-0.06	-0.10	-0.15	-0.24	-0.37
Maximum Drawdown	-12.06	-12.06	-13.81	-17.99	-49.01
Recovery Periode (in Monaten)*	5.00	5.00	13	14	34
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	7.06	5.78	5.18	5.27	5.59

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Aktien Europa ex CH, indexiert

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0004414741
Valor	441474
Bloomberg-ID	AWIEURO
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 11 Uhr
Lancierungsdatum	02.05.1996
Benchmark	MSCI Europe ex CH Total Return Net, in CHF

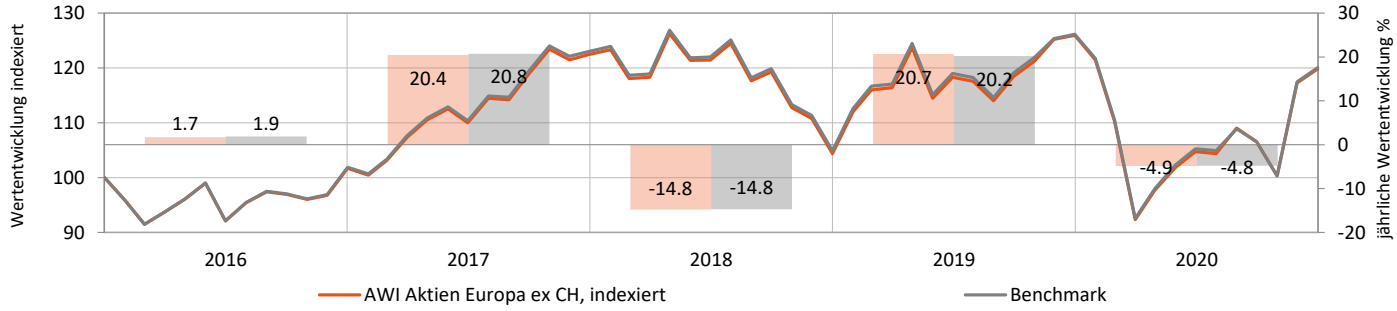
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 2'749.46	CHF 2'890.43
Vermögen	CHF 5'427'834	CHF 13'484'306
Ansprüche	1'974.15	4'665.15
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	> 30
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.36%	0.32%	0.30%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.32%	0.28%	0.26%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	12.45	-4.88	-4.88	-2.19	19.79	50.35	209.48
Benchmark	12.65	-4.82	-4.82	-2.44	20.04	51.94	213.89

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	-4.86	-0.73	3.67	4.16	4.68
Benchmark	-4.81	-0.82	3.72	4.27	4.74

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	1.71	20.42	-14.80	20.69	-4.88
Benchmark	1.90	20.75	-14.75	20.23	-4.82

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	27.82	19.76	17.00	15.33	16.57
Volatilität Benchmark	27.86	19.79	17.03	15.65	16.81
Tracking Error	0.73	0.52	0.41	3.02	2.79
Tracking Error (ex ante)	0.55				
Information Ratio	-0.08	0.16	-0.11	-0.04	-0.02
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	-0.17	-0.04	0.22	0.27	0.28
Beta-Faktor	0.92	0.97	0.98	0.95	0.97
Jensen Alpha	-0.43	0.06	0.03	0.09	0.11
Maximum Drawdown	-24.00	-26.87	-26.87	-26.87	-60.14
Recovery Periode (in Monaten)*	5.00	26.00	26	26	124
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	12.94	9.20	7.91	7.13	7.71

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Aktien Japan, indexiert

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0004414766
Valor	441476
Bloomberg-ID	AWIJAPN
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	02.05.1996
Benchmark	MSCI Japan Total Return Net, in CHF

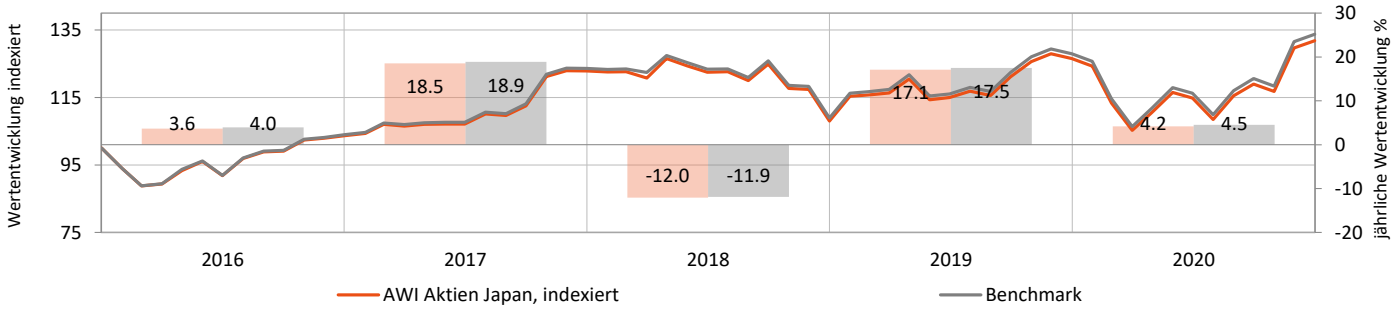
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'075.71	CHF 1'032.68
Vermögen	CHF 49'613'465	CHF 49'981'231
Ansprüche	46'121.48	48'399.48
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	> 30
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.33%	0.29%	0.27%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.32%	0.28%	0.26%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	10.80	4.17	4.17	7.31	31.81	72.46	9.75
Benchmark	10.90	4.51	4.51	8.21	33.72	77.98	15.21

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	4.16	2.38	5.67	5.60	0.38
Benchmark	4.49	2.66	5.98	5.93	0.58

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	3.64	18.52	-12.04	17.12	4.17
Benchmark	3.95	18.88	-11.87	17.49	4.51

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	19.95	14.99	13.51	13.89	14.21
Volatilität Benchmark	20.02	14.96	13.52	13.91	14.27
Tracking Error	0.10	0.59	0.51	0.56	0.56
Tracking Error (ex ante)	0.08				
Information Ratio	-3.27	-0.48	-0.60	-0.59	-0.35
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.21	0.16	0.42	0.40	0.03
Beta-Faktor	0.92	0.97	0.98	0.99	0.99
Jensen Alpha	0.02	-0.22	-0.20	-0.27	-0.19
Maximum Drawdown	-15.34	-17.76	-17.76	-27.86	-65.49
Recovery Periode (in Monaten)*	4.00	6.00	6	20	194
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	9.28	6.97	6.29	6.46	6.61

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Aktien Emerging Markets, indexiert

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0004414774
Valor	441477
Bloomberg-ID	AWIEMMA
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	02.05.1996
Benchmark	MSCI Emerging Markets Total Return Net, in CHF

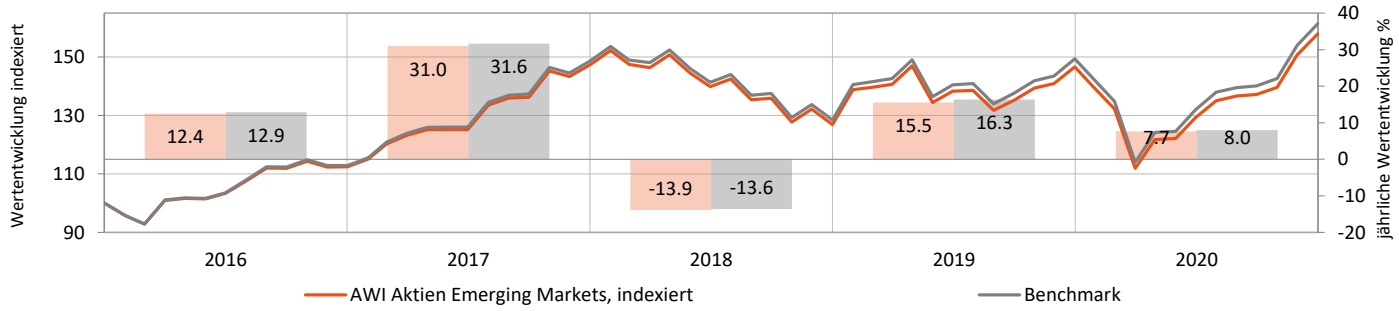
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 3'130.41	CHF 2'907.43
Vermögen	CHF 90'434'165	CHF 97'513'781
Ansprüche	28'888.89	33'539.46
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 30	30-100	> 100
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.47%	0.46%	0.40%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.47%	0.46%	0.40%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	15.09	7.67	7.67	7.15	57.86	30.91	249.07
Benchmark	15.16	7.99	7.99	8.57	61.33	35.44	264.40

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	7.65	2.33	9.55	2.73	5.19
Benchmark	7.97	2.78	10.03	3.08	5.38

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	12.45	31.02	-13.86	15.53	7.67
Benchmark	12.89	31.63	-13.59	16.33	7.99

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	22.57	17.42	15.37	14.70	16.16
Volatilität Benchmark	22.68	17.45	15.41	14.76	16.16
Tracking Error	0.21	0.21	0.20	0.45	0.88
Tracking Error (ex ante)	0.16				
Information Ratio	-1.54	-2.12	-2.42	-0.77	-0.21
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.34	0.13	0.62	0.19	0.32
Beta-Faktor	0.92	0.97	0.98	0.99	0.99
Jensen Alpha	0.32	-0.37	-0.28	-0.31	-0.14
Maximum Drawdown	-19.52	-26.47	-26.47	-26.47	-60.11
Recovery Periode (in Monaten)*	8.00	34.00	34	34	124
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	10.50	8.10	7.15	6.84	7.52

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Aktien Welt ex CH, indexiert

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0017677243
Valor	1767724
Bloomberg-ID	AWAWECH
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	13.02.2004
Benchmark	MSCI World ex CH Total Return Net Index, in CHF

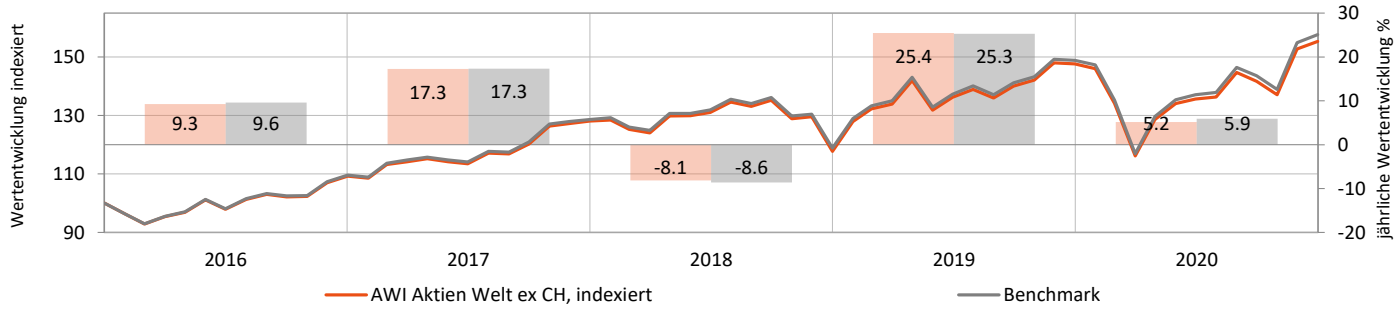
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 2'412.32	CHF 2'293.26
Vermögen	CHF 50'000'560	CHF 5'465'893
Ansprüche	20'727.17	2'383.46
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	> 30
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.34%	0.30%	0.28%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.32%	0.28%	0.26%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	9.61	5.19	5.19	21.23	55.32	137.36	140.03
Benchmark	9.83	5.92	5.92	22.54	57.64	144.19	149.33

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	5.18	6.62	9.19	9.02	5.31
Benchmark	5.91	7.01	9.52	9.33	5.55

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	9.26	17.27	-8.13	25.44	5.19
Benchmark	9.63	17.34	-8.64	25.27	5.92

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	23.71	17.52	14.80	13.36	14.14
Volatilität Benchmark	23.94	17.55	14.83	13.40	14.20
Tracking Error	0.30	0.30	0.24	0.30	0.29
Tracking Error (ex ante)	0.20				
Information Ratio	-2.44	-1.29	-1.37	-1.02	-0.82
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.22	0.38	0.62	0.68	0.38
Beta-Faktor	0.91	0.97	0.98	0.99	0.99
Jensen Alpha	-0.22	-0.18	-0.15	-0.20	-0.18
Maximum Drawdown	-20.44	-21.50	-21.50	-22.64	-54.18
Recovery Periode (in Monaten)*	7.00	9.00	9	13	81
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	11.03	8.15	6.89	6.22	6.58

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Immobilien Schweiz

Eckdaten

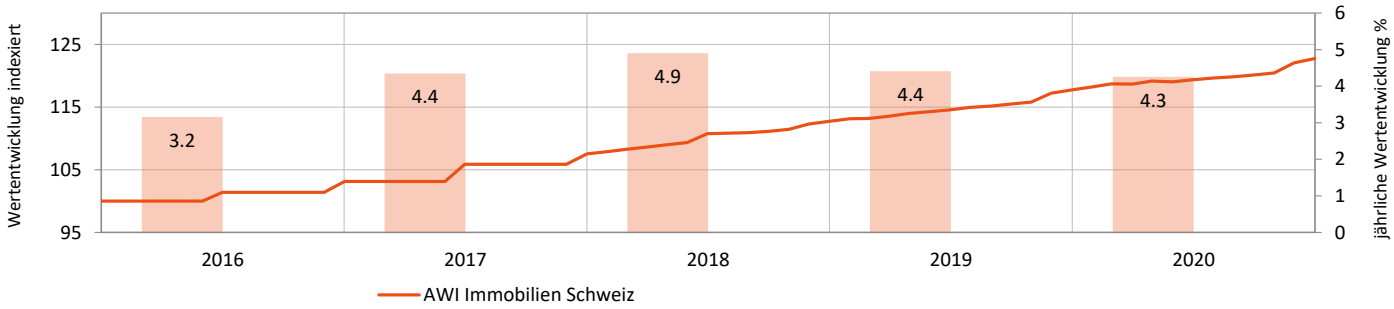
Übersicht	
Währung	CHF
ISIN	CH0047352403
Valor	4735240
Bloomberg-ID	keine
Bewertungsintervall	monatlich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	siehe Gebührenreglement
Lancierungsdatum	05.12.2008
Benchmark	keine

Eckdaten	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'160.32	CHF 1'146.54
Vermögen	CHF 97'888'995	CHF 86'637'470
Ansprüche	84'364.00	75'564.00
Letzte Ausschüttung (21.04.2020)		CHF 34.00

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	> 30
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	0.66%	0.64%	0.63%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.40%	0.38%	0.37%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	2.17	4.26	4.26	14.15	22.74	52.39	59.87
kein Benchmark	-	-	-	-	-	-	-

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	4.24	4.51	4.18	4.30	3.96
kein Benchmark	-	-	-	-	-

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	3.16	4.35	4.90	4.41	4.26
kein Benchmark	-	-	-	-	-

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	1.21	1.31	1.91	2.45	2.37
Volatilität Benchmark	-	-	-	-	-
Tracking Error	-	-	-	-	-
Tracking Error (ex ante)	-				
Information Ratio	-	-	-	-	-
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	3.51	3.45	2.19	1.75	1.67
Beta-Faktor	-	-	-	-	-
Jensen Alpha	-	-	-	-	-
Maximum Drawdown	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11	-0.11
Recovery Periode (in Monaten)*	1.00	1.00	1	1	1
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	0.56	0.61	0.89	1.14	1.10

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

AWI Immobilien Schweiz Indirekt

Eckdaten

Übersicht

Währung	CHF
ISIN	CH0285079122
Valor	28507912
Bloomberg-ID	AWISIAC
Bewertungsintervall	täglich
Ausgabe/Rücknahme von Anteilen	täglich bis 12 Uhr
Lancierungsdatum	31.08.2015
Vergleichsindex	SXI Real Estate Funds Broad Index

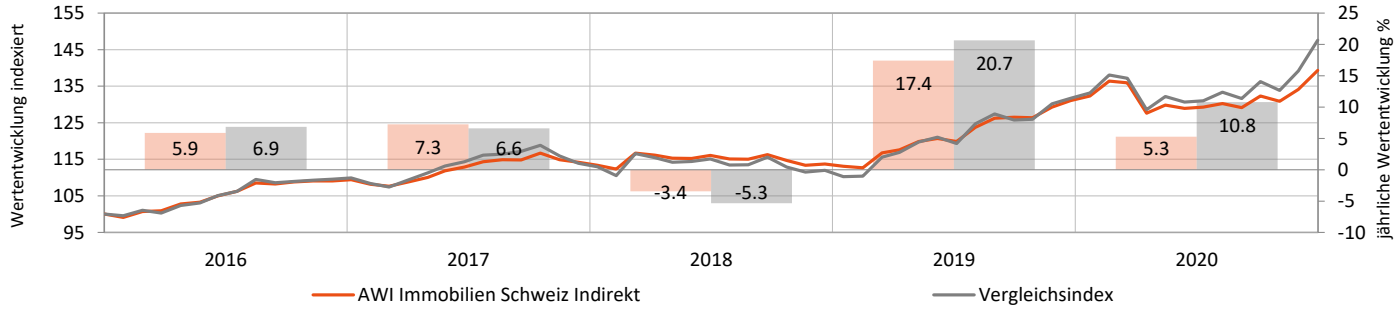
Eckdaten

	31.12.2020	31.12.2019
NAV (per 31.12.2020)	CHF 1'393.29	CHF 1'323.33
Vermögen	CHF 34'969'854	CHF 36'790'827
Ansprüche	25'098.78	27'801.65
Ausschüttung	thesaurierend	thesaurierend

Gebühren

Gesamtanlagevermögen (in Mio. CHF)	< 20	20-30	> 30
TER KGAST 2019 (abzgl. Rabatt)	1.38%	1.34%	1.32%
Verwaltungsgebühr p.a. (abzgl. Rabatt)	0.56%	0.52%	0.50%

Wertentwicklung Netto (in CHF)



Performance Netto (in %)

Kumulative Performance	3 Monate	YTD	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	5.28	5.29	5.29	19.38	35.59	-	39.33
Vergleichsindex	8.32	10.81	10.81	26.60	44.19	-	47.58

Annualisierte Performance	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Anlagegruppe	5.27	6.08	6.27	-	6.41
Vergleichsindex	10.78	8.17	7.59	-	7.56

Jahresperformance	2016	2017	2018	2019	2020
Anlagegruppe	5.90	7.26	-3.43	17.41	5.29
Vergleichsindex	6.85	6.60	-5.32	20.67	10.81

Risikoanalyse

in %	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Auflage
Volatilität Anlagegruppe	8.87	6.59	5.56	-	5.48
Volatilität Benchmark	11.16	8.77	7.50	-	7.37
Tracking Error	2.99	2.78	2.49	-	2.48
Tracking Error (ex ante)	3.75				
Information Ratio	-1.84	-0.75	-0.53	-	-0.46
Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%)	0.59	0.92	1.13	-	1.17
Beta-Faktor	0.72	0.71	0.71	-	0.71
Jensen Alpha	-2.48	0.26	0.90	-	1.05
Maximum Drawdown	-6.47	-6.47	-6.47	-	-6.47
Recovery Periode (in Monaten)*	3.00	3.00	3	(0)	10
Value at Risk (Konfidenzniveau 95%)	4.13	3.07	2.59	-	2.55

* Anzahl Monate, Werte in Klammern indizieren nicht abgeschlossene Recovery Period

Ausweis gemäss Verordnung des EDI[1]

AWI Obligationen Inland CHF

Benchmark: SBI AAA-BBB Domestic Total Return

Benchmarkfremde Anlagen	(%)[2]	Schuldner > 10%[3] Beteilungen > 5%	(%)[2]
Swiss Prime Site AG	0.30	keine	
Pfandbriefzentrale	1.55		

AWI Obligationen Ausland CHF

Benchmark: SBI Foreign AAA-BBB Total Return

Benchmarkfremde Anlagen	(%)[2]	Schuldner > 10%[3] Beteilungen > 5%	(%)[2]
Commerzbank Finance & Covered Bond SA	0.58	keine	
Schweizerische Pfandbriefinstitute	2.95		

[1] Eidgenössisches Department des Innern (EDI): «Verordnung des EDI über die Voraussetzungen für die Überschreitung der Schuldner- und Gesellschaftsbegrenzungen von Anlagestiftungen» nach Art. 54 und Art. 54a BVV 2 gestützt auf Art. 26 a Abs. 3 ASV, in Kraft seit 1. August 2019.

[2] Anteile am NAV

[3] Ohne Eidgenossenschaft und schweizerische Pfandbriefinstitute

AWI Global Staatsanleihen

Benchmark: FTSE World Government Bond Index ex CH Total Return, in CHF

Benchmarkfremde Anlagen	(%)[2]	Schuldner > 10%[3] Beteilungen > 5%	(%)[2]
Credit Agricole S.A. London Branch	0.69	USA	29.85
Enexis Holding N.V.	0.17	Japan	18.00
European Investment Bank	0.30	Italien	11.42
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau KFW	4.12		
Spain	1.03		
Province of British Columbia	4.12		

AWI Global Staatsanleihen Hedged CHF

Benchmark: FTSE World Government Bond Index ex CH Total Return, hedged CHF

Benchmarkfremde Anlagen	(%)[2]	Schuldner > 10%[3] Beteilungen > 5%	(%)[2]
Credit Agricole S.A. London Branch	0.69	USA	29.85
Enexis Holding N.V.	0.17	Japan	18.00
European Investment Bank	0.30	Italien	11.42
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau KFW	4.12		
Spain	1.03		
Province of British Columbia	4.12		

AWI Aktien Schweiz SMC

Benchmark: SPI ex SLI Total Return

Benchmarkfremde Anlagen	(%)[2]	Schuldner > 10%[3] Beteilungen > 5%	(%)[2]
Straumann Holding AG	3.96	keine	
Temenos AG	3.08		
Sonova Holding AG	3.72		
Logitech international S.A.	4.82		

AWI Aktien Schweiz, indexiert

Benchmark: SPI Total Return

Benchmarkfremde Anlagen	(%)[2]	Schuldner > 10%[3] Beteilungen > 5%	(%)[2]
keine		Nestle	19.58
		Roche Holdings	14.13
		Novartis	13.65

AWI Aktien Emerging Markets, indexiert

Benchmark: MSCI Emerging MarketsTotal Return Net, in CHF

Benchmarkfremde Anlagen	(%)[2]	Schuldner > 10%[3] Beteilungen > 5%	(%)[2]
keine		Alibaba Group	6.80
		Tencent Holdings Ltd	5.69
		Taiwan Manufactor. Co	5.66

Anzahl der gehaltenen Schuldner und Gesellschaften

Anzahl der gehaltenen Schuldner und Gesellschaften

Anlagegruppe	Anzahl Schuldner und Gesellschaften
AWI Obligationen Inland CHF	55
AWI Obligationen Inland CHF Redex	55
AWI Wohnbauhypotheken Schweiz	-
AWI Obligationen Ausland CHF	87
AWI Global Staatsanleihen	20
AWI Global Staatsanleihen Hedged CH	20
AWI Global SmartBeta Unternehmensanleihen Hedged CHF	242
AWI Aktien Schweiz SMC	48
AWI Global SmartBeta Aktien ESG	337
AWI BVG 25 andante	2'358
AWI BVG 35 allegro	2'358
AWI BVG 45 vivace	2'358
AWI Insurance Linked Strategies	-
AWI KMU Darlehen CHF	-
AWI Aktien Schweiz, indexiert	209
AWI Aktien Europa ex CH, indexiert	296
AWI Aktien Japan, indexiert	301
AWI Aktien Emerging Markets, indexiert	1'399
AWI Aktien Welt ex CH, indexiert	602
AWI Immobilien Schweiz	-
AWI Immobilien Schweiz indirekt	10

Kontaktadresse

Anlagestiftung Winterthur für Personalvorsorge (AWI)
Bahnhofplatz 8, CH-8400 Winterthur,
Tel. +41 (0)52 202 02 30, Fax +41 (0)52 202 02 40
awi-anlagestiftung.ch
awi@awi-anlagestiftung.ch
Mitglied der KGAST