

Swiss Franc Bonds Optimized

Anteilsklasse: N CHF CAP

Marketingmaterial

Daten per 30.06.2026

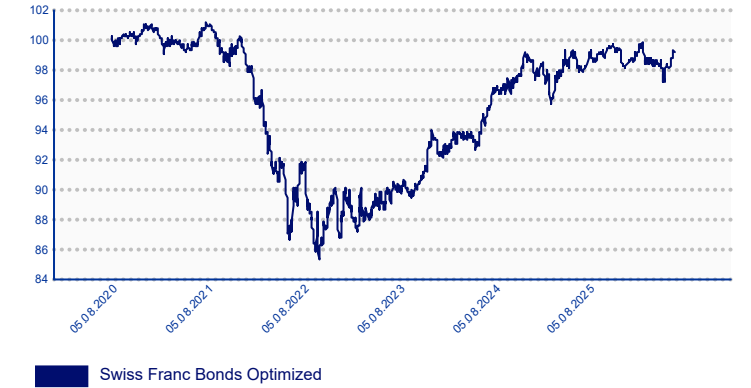
Anlagepolitik

Das Anlagegefäss "Swiss Franc Bonds Optimized" investiert in auf CHF denominierte Obligationen weltweit mit Investment Grade Rating (zum Zeitpunkt der Kaufentscheidung) mit bestmöglicher Marktliquidität. Bei der Auswahl der Schuldner halten wir uns an den Grundsatz einer optimierten Risikoverteilung für das Portfolio. Die Laufzeitenallokation des Portfolios resultiert aus einer Optimierung des Rollertrags, wobei sich die Zusammensetzung und die durchschnittliche Laufzeit des Portfolios grundsätzlich an der Benchmark orientieren. Der Fonds setzt eine insgesamt nachhaltige Anlage des Vermögens um und ist als Kollektivvermögen mit Nachhaltigkeitsbezug klassifiziert.

Benchmark: SBI AAA-BBB Total Return.

Wertentwicklung

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Indikator für zukünftige Ergebnisse.



Fondsinformationen

Asset Manager:	Baloise Asset Management AG
Depotbank:	UBS Switzerland AG, Zürich
Revisionsstelle:	Ernst & Young AG, Basel
Domizil:	Schweiz
Lancierungsdatum:	05.08.2020
Währung:	CHF
Zeichnungsschluss:	14:30
Valoren-Nr:	51280189
Bloomberg:	BAFBONC SW
ISIN:	CH0512801892
Fondsvermögen:	1'258'355'979
Vermögen der Anteilsklasse:	163'708'543
Nettoinventarwert pro Anteil (NAV):	98.21
Ertragsverwendung:	Thesaurierend
Laufende Kosten:	0.33%
Durchschnittsrating:	AA

Netto-Performance	Fonds	Benchmark
Monatsperformance	0.78%	0.78%
YTD	0.85%	0.74%
5 Jahre (ann.)	-0.12%	-0.10%
Seit Auflegung (ann.)	-0.13%	-0.15%
2025	-0.33%	-0.09%
2024	5.71%	5.35%
2023	7.49%	7.36%
2022	-12.26%	-12.10%
2021	-1.91%	-1.82%

Risikokennzahlen	Fonds	Benchmark
Maximum Drawdown	15.66%	14.95%
Volatilität (3 Jahre)	2.92%	2.88%
Sharpe Ratio (3 Jahre)	0.49	0.45
Tracking Error (3 Jahre)	0.18%	
Modified Duration	7.13	7.07
Yield to Maturity	0.82%	0.79%

Die 10 grössten Positionen

Swiss Confederation Government Bond, 4.00%, 06/01/49	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH0009755197	1.0%
Swiss Confederation Government Bond, 2.25%, 22/06/31	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH0127181029	1.0%
Swiss Confederation Government Bond, 1.50%, 30/04/42	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH0127181169	0.9%
Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 27/05/30	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH0224397171	0.9%
Swiss Confederation Government Bond, 0.00%, 22/06/29	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH0224397346	0.9%
Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 27/06/32	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH0344958688	0.8%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.90%, 26/10/35	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH1392903626	0.8%
Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 28/05/40	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH0557779235	0.8%
Swiss Confederation Government Bond, 0.25%, 23/06/35	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH0557778310	0.8%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.90%, 15/12/39	Rentenpapier	CHF	Switzerland	CH1487332053	0.8%

Swiss Franc Bonds Optimized

Anteilstklasse: N CHF CAP

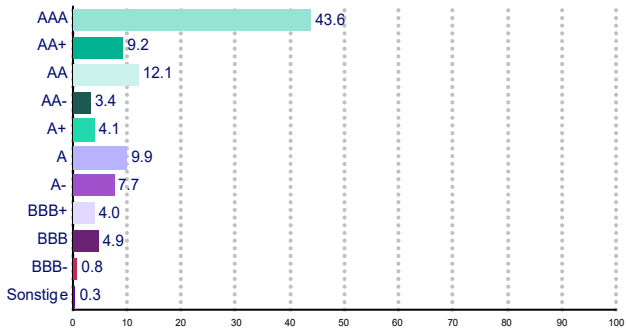
Marketingmaterial

Daten per 30.06.2026

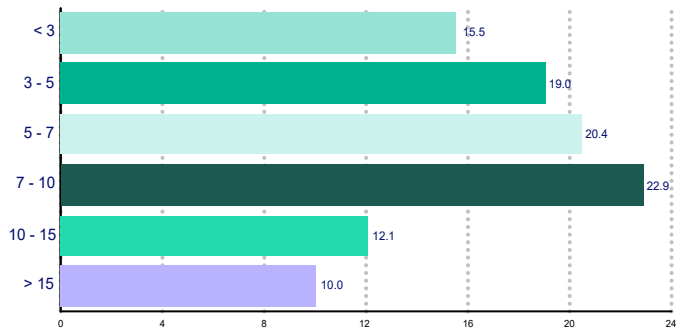
Aufteilung nach Regionen

Switzerland	73.59
United States	5.32
France	4.41
Germany	3.66
Canada	3.00
Spain	1.60
Australia	1.22
United Kingdom	1.16
Austria	0.75
Liechtenstein	0.69
Other	4.61

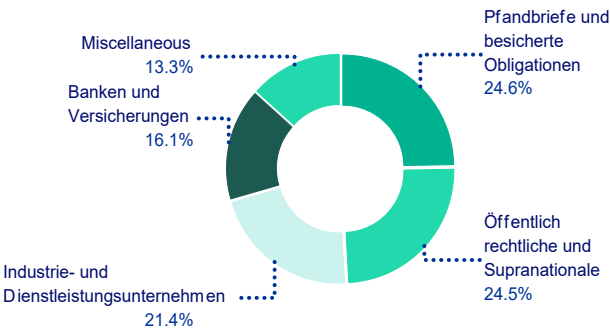
Aufteilung nach Rating (in %)



Aufteilung nach Laufzeit (in %, pro Jahr)



Schuldnerstruktur



Swiss Franc Bonds Optimized

Anteilstklasse: N CHF CAP

Marketingmaterial

Daten per 30.06.2026

Verantwortungsbewusste Strategie

Detailliertere Informationen zum Thema verantwortungsbewusstes Investieren können dem Fondsprospekt sowie den fondsspezifischen Informationen im Anhang 1 des Fondsprospektes «Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen» entnommen werden. Im Anhang 1 werden unter anderem die ökologischen und/oder sozialen Merkmale der Teilvermögen, die Nachhaltigkeitsindikatoren sowie die verantwortungsbewusste Anlagestrategie beschrieben.

Die Baloise RI Strategie kann unter folgendem Link abgerufen werden: <https://www.baloise.com/de/home/ueber-uns/wofuer-wir-stehen/nachhaltigkeit.html>

Verantwortungsbewusste Ansätze

✓	Allgemeine Ausschlüsse	✓	Erweiterte Ausschlüsse	✓	ESG Integration
✓	Positive Screening	✓	Klimaausrichtung		

Ausschlusskriterien*

	Ratingbezogene Ausschlüsse		Tabak		Konventionelles Öl & Gas
	Kohle		Umstrittene Waffen		Normenbezogene Ausschlüsse
	Konventionelle Waffen		Unkonventionelles Öl und Gas		

(*) Für die Ausschlusskriterien werden in der Regel Schwellenwerte angewendet.

Swiss Franc Bonds Optimized

Anteilsklasse: N CHF CAP

Marketingmaterial

Daten per 30.06.2026

Anlagerisiken

Bitte konsultieren Sie den Fondsprospekt respektive Fondsvertrag, um vollständige Informationen über die Anlagerisiken zu erhalten.

Allgemeine Anlagerisiken: Der Wert der Anlagen richtet sich nach dem jeweiligen Marktwert. Je nach generellem Börsentrend und der Entwicklungen der in einem Fonds gehaltenen Titel kann der Inventarwert erheblich schwanken. Es besteht keine Gewähr dafür, dass das jeweilige Anlageziel der Fonds erreicht wird oder dass der Anleger das gesamte von ihm investierte Kapital zurückerhält, einen bestimmten Ertrag erzielt oder die Anteile zu einem bestimmten Preis an die Fondsleitung zurückgeben kann. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit lässt nicht auf künftige Anlageergebnisse schliessen.

Marktrisiko: Das Marktrisiko ist ein allgemeines, mit allen Anlagen verbundenes Risiko. Eine Verschlechterung der Marktbedingungen oder eine allgemeine Unsicherheit in Bezug auf die Wirtschaftsmärkte kann zum Rückgang des Marktwertes bestehender oder potenzieller Anlagen oder zu einer erhöhten Illiquidität von Anlagen führen. Derartige Rückgänge bzw. eine derartige Illiquidität könnte(n) zu Verlusten und geringeren Anlagemöglichkeiten für ein Fonds führen. Ursachen für Marktrisiken können insbesondere politische Unsicherheiten, Währungsexportbeschränkungen, Änderungen von Gesetzen und fiskalischen Rahmenbedingungen sein.

Währungsrisiko: Ein Währungsrisiko besteht, wenn der Fonds in Vermögenswerte investiert, die auf Fremdwährung lauten. Eine eventuelle Abwertung der Fremdwährung gegenüber der Basiswährung des Fonds führt dazu, dass der Wert der auf Fremdwährung lautenden Vermögenswerte sinkt.

Derivatrisiko: Durch den Einsatz von Derivaten steigt aufgrund der Hebelwirkung (Leverage) die Wahrscheinlichkeit von Verlusten. Derivate ermöglichen es den Anlegern, bei kleinen Kursbewegungen des Basisinstruments hohe Erträge zu erzielen. Allerdings können die Anleger auch große Verluste erleiden, wenn sich der Kurs des Basisinstruments deutlich zu ihren Ungunsten entwickelt.

Nachhaltigkeitsrisiko: Ein Nachhaltigkeitsrisiko ist ein Ereignis oder eine Bedingung in den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung, dessen beziehungsweise deren Eintreten tatsächlich oder potenziell wesentliche negative Auswirkungen auf den Wert der Investitionen des Fonds haben könnte.

Schwellenländerrisiko: Anlagen in Schwellenländern sind mit anderen und/oder höheren Risiken verbunden als Anlagen in Wertpapieren von Industrieländern. In Schwellenländern ist die rechtliche, gerichtliche und aufsichtsrechtliche Infrastruktur noch im Aufbau, weshalb für die lokalen Marktteilnehmer wie auch für ihre Gegenparteien grosse Rechtsunsicherheit besteht. Darüber hinaus handelt es sich tendenziell um Märkte mit geringer Marktkapitalisierung, die dazu neigen, volatil und illiquide zu sein.

Begriffserklärung

Maximum Drawdown: Risikokennzahl, die den höchsten Verlust wiedergibt den ein Investor bis dato mit einer Kapitalanlage hätte erleiden können. Er misst die grösste Verluststrecke von einem vorherigen Höchststand bis zu einem späteren Tiefpunkt.

Volatilität: Die Volatilität bezeichnet das Ausmass und Häufigkeit der Preisschwankung von Wertschriften, Rohstoffen, Finanzderivaten etc. während einer bestimmten Periode. Sie wird gemessen als Abweichung vom Mittelwert der Preisveränderung in diesem Zeitraum.

Aktienrisiko (Equity Exposure): Das Aktienrisiko ist dasjenige Wertschwankungs- und -Verlustrisiko, das dem Investor durch negative Veränderung des Aktienwertes des direkt oder indirekt in Aktien investierten Teils des Portfolios erwächst.

Sharpe Ratio: Risikoadjustierte Rendite, die die Rentabilität einer Kapitalanlage zu seiner Volatilität ins Verhältnis setzt. Eine Kapitalanlage mit höherem Sharpe Ratio liefert pro Risikoeinheit eine höhere Rendite.

Risk/Return Ratio: Risikoadjustierte Rendite, die die Rentabilität einer Kapitalanlage zu seinem Maximum Drawdown ins Verhältnis setzt. Eine Kapitalanlage mit höherem Risk/Return Ratio liefert pro Risikoeinheit eine höhere Rendite.

Laufende Kosten: Die laufenden Kosten ergeben sich aus dem Verhältnis der Kosten zum durchschnittlichen Fondsvermögen. Alle Kosten, die dem Fondsvermögen direkt belastet werden und die Performance des Fonds vermindern, werden bei den laufenden Kosten berücksichtigt, allen voran die jährliche Management Fee. Verglichen mit dem Total Expense Ratio berücksichtigen die laufenden Kosten weitere Kostenkomponenten, insbesondere die Kosten von Zielfonds, in die der Fonds investiert.

Future (Termin-Kontrakt): Als Future (Termin-Kontrakt) bezeichnet man eine verpflichtende Vereinbarung zweier Parteien, an einem bestimmten Datum in der Zukunft einen Vermögenswert zu einem vordefinierten Preis und vordefinierten Bedingungen an einer Terminbörse zu handeln. Dabei wird der Verlust/Gewinn aus der Futures-Position täglich "Market-to-Market" verrechnet.

SFDR: Sustainable Finance Disclosure Regulation - VERORDNUNG (EU) 2019/2088 DES EUROPÄISCHEN PARLAMENTS UND DES RATES vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Swiss Franc Bonds Optimized

Anteilkategorie: N CHF CAP**Marketingmaterial**

Daten per 30.06.2026

Wichtiger Rechtshinweis

Das vorliegende Werbedokument dient ausschliesslich Informationszwecken und stellt weder eine Empfehlung noch ein Angebot oder eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Fondsanteilen dar, noch ist es als Aufforderung anzusehen, ein Angebot zum Abschluss eines Vertrages über eine Wertpapierdienstleistung oder Nebenleistung abzugeben. Es richtet sich ausdrücklich nicht an Personen, deren Nationalität oder Wohnsitz den Zugang zu solchen Informationen aufgrund der geltenden Gesetzgebung verbietet. Weder das vorliegende Dokument noch Kopien davon dürfen in die Vereinigten Staaten versandt oder dahin mitgenommen werden oder in den Vereinigten Staaten oder an eine US-Person (im Sinne von Regulation S des US Securities Act von 1933 in dessen jeweils gültiger Fassung) abgegeben werden. Dieses Dokument kann eine persönliche Beratung nicht ersetzen. Für die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der in diesem Dokument enthaltenen Angaben wird keine Haftung übernommen. Baloise Fund Invest (CH) ist ein Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen. Weiterführende Informationen können den jeweiligen Produktinformationen wie Basisinformationsblatt und Prospekt mit integriertem Fondsvertrag entnommen werden. Für einzelne Teilvermögen oder Anteilsklassen kann der Anlegerkreis im Prospekt mit integriertem Fondsvertrag zusätzlich eingeschränkt werden. Allein verbindliche Grundlage für den Erwerb von Fondsanteilen ist der aktuelle Prospekt mit integriertem Fondsvertrag und der jeweils aktuelle Jahresbericht. Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag sowie der Jahresbericht und Halbjahresbericht können kostenlos angefordert werden bei der Fondsleitung, der UBS Fund Management (Switzerland) AG, Zürich oder bei der Depotbank, der UBS Switzerland AG, Zürich oder bei der Vertriebsstelle, der Baloise Asset Management AG, Aeschengraben 21, CH-4002 Basel.

"Swiss Exchange AG ("SIX Swiss Exchange") ist die Quelle des Swiss Bond Index Total AAA-BBB und der darin enthaltenen Daten. SIX Swiss Exchange war in keinerlei Form an der Erstellung der in dieser Berichterstattung enthaltenen Informationen beteiligt. SIX Swiss Exchange übernimmt keinerlei Gewährleistung und schliesst jegliche Haftung (sowohl aus fahrlässigem sowie aus anderem Verhalten) in Bezug auf die in dieser Berichterstattung enthaltenen Informationen - wie unter anderem für die Genauigkeit, Angemessenheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Rechtzeitigkeit und Eignung für beliebige Zwecke - sowie hinsichtlich Fehlern, Auslassungen oder Unterbrechungen im Swiss Bond Index total AAA-BBB oder dessen Daten aus. Jegliche Verbreitung oder Weitergabe der von SIX Swiss Exchange stammenden Informationen ist untersagt."

Zahl- und Informationsstellen sowie Ansprechpartner Vertrieb:

Baloise Asset Management AG
Aeschengraben 21
Postfach
4002 Basel
assetmanagement@baloise.com

Nehmen Sie Kontakt mit uns auf

Internet: www.baloise.ch
E-Mail: assetmanagement@baloise.ch