

VPV Chance Plus Fonds

Factsheet, 30 September 2021

Nur für professionelle Kunden und geeignete Gegenparteien / Nur für institutionelle Investoren

Anlageziel des Fonds

Kapitalzuwachs

Wesentliche Anlegerinformationen

Name

VPV Chance Plus Fund

Währung

EUR

Wesensart des Fonds

OGAW (UCITS)

Verwaltungsgesellschaft

Lantern Structured Asset Management Limited (LSAM)

Advisor

Allianz Global Investors GmbH

Kapitalverwaltungsgesellschaft

Lantern Structured Asset Management Limited (LSAM)

Verwahrstelle

State Street Custodial Services (Ireland) Limited

Fondsadministrator

State Street Fund Services (Ireland) Limited

Swap Gegenpartei

UBS AG, London Branch

Replikationsmethodik

Synthetisch (Swap-basiert)

ISIN

IE00BMDV6S38

WKN

A3CNWH

Bloomberg Kürzel

VPVCP1E ID

Auflage/Rücknahme Frequenz

Täglich

Gesamtkosten

1.50% pro Jahr

Ausgabeaufschlag

0.0%

Rücknahmegebühr

0.0%

Auflagedatum

3 August 2021

* Gemäss Datierung dieses Factsheets

§ Berücksichtigt keine Transaktionskosten

Anlagestrategie

Das Anlageziel des VPV Wachstum Fonds ist es die Rendite eines dynamischen Portfolios abzubilden. Das dynamische Portfolio baut auf einem regelbasierten Algorithmus auf, welcher die Allokation in ein Investmentportfolio und einen Reservevermögenswert steuert. Die Allokation des Investmentportfolios wird dabei von Allianz Global Investors GmbH bestimmt.

Das dynamische Portfolio folgt einer synthetisch replizierten Strategie, die über einen Swap dargestellt wird. Die Währung des dynamischen Portfolios ist Euro.

Der zugrundeliegende Algorithmus wurde von Allianz Global Investors GmbH entwickelt und zielt darauf ab, an steigenden Aktien- und/oder Rentenmärkten zu partizipieren. Ein eingebauter Sicherungsmechanismus im Algorithmus stellt sicher, dass jeder Fondspreis zum ersten Bewertungstag des Monats nicht weniger als 80% des Fondspreises am ersten Bewertungstag des Vormonats beträgt.

Das Investmentportfolio kann aus folgenden Märkten/ Anlageklassen bestehen:

- (i) Aktien und Futures aus entwickelten Märkten;
- (ii) Renten Futures;
- (iii) Geld und Geldwert Äquivalente;
- (iv) Forwards auf Währungen der G10- Staaten, zur Absicherung von Währungsschwankungen

Der Reservevermögenswert entspricht einer Nominalinvestition in einen EUR denominierten Zinssatz. Dieser ist an die "EONIA" Rate gebunden.

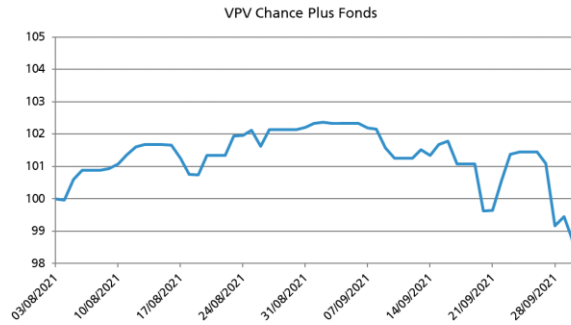
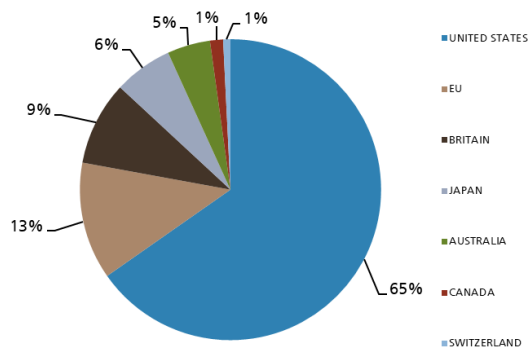
Kommentar zur Wertentwicklung des Fonds

Marktüberblick: Im dritten Quartal setzten die weltweiten Aktienmärkte ihren Aufwärtstrend fort, der durch das positive Wachstum der Unternehmensgewinne begünstigt wurde. Anleihen schwankten, wobei die 10-jährigen Renditen in den USA und im Vereinigten Königreich höher ausfielen, während sie in der Eurozone und in Japan nahezu unverändert blieben.

Marktzyklusanalyse: Die Bewertungen fielen weiterhin zugunsten risikoreicherer Anlagen aus, während die traditionell defensiven Anlageklassen allgemein schwächer bewertet wurden. Die Schwäche der Schwellenländeraktien und die Stärke des US-Dollars trugen zu ihrer geringeren bzw. höheren Bewertung bei.

Fundamentalanalyse: Bei den Aktien profitieren die Eurozone und Japan von der sich verbessernden Virus-Dynamik. Im Bereich der festverzinslichen Wertpapiere stehen einem vorsichtigen Ausblick für US-Staatsanleihen und US-Hochzinsanleihen allgemein neutrale Einschätzungen für Europa und die Schwellenländer gegenüber.

Fondstruktur nach Land



Stand: 30 September 2021

Wertentwicklung VPV Wachstum Fonds

Top 10 Einzeltitel*

1 MSCI USA ESG Leaders	65.28%
2 MSCI EMU ESG Leaders	12.61%
3 MSCI UK ESG Leaders	9.02%
4 NIKKEI 225 (OSE) Dec21	6.30%
5 SPI 200 FUTURES Dec21	4.62%
6 MSCI Canada ESG Leaders	1.40%
7 MSCI Switzerland	0.78%
8	N/A
9	N/A
10	N/A

Wertentwicklungskennzahlen	Fonds
1-Monatsrendite	-3.42%
3-Monatsrendite	N/A
Rendite seit Jahresbeginn	-1.29%
1-Jahresrendite	N/A
3-Jahresrendite	N/A
5-Jahresrendite	N/A
Annualisierte Rendite [^]	-7.85%
Annualisierte Volatilität [^]	7.12%
Sharpe Ratio [§]	-1.026

Fonds Nettovermögen und Bezugsinformation*

Fonds Nettovermögen (EUR)	98.71
Abgesichertes Vermögen (EUR)	81.86
Anteil im Investitionsportfolio	100%
Anteil im Reserveanlagevermögen	0%

* Gemäss Datierung dieses Factsheets

* Gemäss Datierung dieses Factsheets

[^] Seit Auflagedatum

[§] Referenzzinssatz 3 Monats EURIBOR

Wertentwicklungen aus der Vergangenheit sind kein zuverlässiger Indikator für zukünftige Wertentwicklungen.

Risiken

- Das Nettovermögen des Fonds kann unter Umständen auf das im Schutzmechanismus inbegriffene Niveau von 80% fallen.
- Das Sicherungsniveau des Fonds wird monatlich angepasst. So kann es dazu kommen, dass das Sicherungsniveau zum Beginn eines Monats unter dem Sicherungsniveau zu Beginn des letzten Monats liegt.
- Das Investmentportfolio unterliegt Währungsschwankungen. Einige aber nicht alle Vermögenswerte des Fonds sind gegen Währungsrisiken abgesichert.
- Die angewendete Investitionsmethodik kann dazu führen, dass der Fonds im Vergleich zu ähnlichen Investitionen schlechter abschneidet. Dies ist durch das Risikomanagement der Investmentstrategie und die damit verbundenen Opportunitätskosten bedingt, welche durch die geringere Allokation in das Investitionsportfolio (weniger als 100%) entstehen. Das Risikomanagement schützt das Nettovermögen des Fonds aber gegen Marktverluste.

Disclaimer

These materials have been prepared by UBS AG and/or a subsidiary and/or an affiliate thereof "UBS".

These materials are for distribution only under such circumstances as may be permitted by applicable law. They have not been prepared with regard to the specific investment objectives, financial situation or particular needs of any specific recipient. They are published solely for informational purposes and are not to be construed as a solicitation or an offer to buy or sell any securities or related financial instruments or to participate in any particular trading strategy. Options, derivative products and futures are not suitable for all investors, and trading in these instruments is considered risky.

The recipient should not construe the contents of these materials as legal, tax, accounting, regulatory, or other specialist or technical advice or services or investment advice or a personal recommendation. Foreign currency rates of exchange may adversely affect the value, price or income of any security or related instrument mentioned in these materials. No representation or warranty, either express or implied, is provided in relation to the accuracy, completeness or reliability of the information contained herein except with respect to information concerning UBS, nor is it intended to be a complete statement or summary of the securities markets or developments referred to in these materials or a guarantee that the services described herein comply with all applicable laws, rules and regulations. They should not be regarded by recipients as a substitute for the exercise of their own judgment.

Any opinions expressed in these materials are subject to change without notice and may differ or be contrary to opinions expressed by other business areas or groups of UBS as a result of using different assumptions and criteria.

UBS is under no obligation to update or keep current the information contained herein, and past performance is not necessarily indicative of future results. UBS, its directors, officers, employees or clients may have or have had interest or long or short positions in the securities or other financial instruments referred to herein and may at any time make purchases and/or sales in them as principal or agent. UBS may act or have acted as market-maker in the securities or other financial instruments discussed in these materials.

Furthermore, UBS may have or have had a relationship with or may provide or have provided investment banking, capital markets and/or other financial services to the relevant companies. Neither UBS nor any of its directors, officers, employees or agents accepts any liability for any loss or damage arising out of the use of all or any part of these materials or reliance upon the information contained herein. Additional information may be made available upon request. Clients wishing to effect transactions should contact their local sales representative.

Germany

These materials are distributed in Germany by VPV Lebensversicherungs AG.

UBS specifically prohibits the redistribution or reproduction of these materials in whole or in part without the written permission of UBS and UBS accepts no liability whatsoever for the actions of third parties in this respect. © UBS 2021. The key symbol and UBS are among the registered and unregistered trademarks of UBS. All rights reserved.

For further information on the VPV Wachstum Fund, please contact your advisor.