

# Swisscanto (LU) Portfolio Fund Green Invest Balanced (EUR) B

**Februar 2012 | Ausgabe Deutschland**

WKN: A0DQU1 | ISIN-Nummer: LU0208341536 | Bloomberg: SPFGIBR LX | Reuters: SWCA3

**Beschreibung**

Der Fonds investiert weltweit in Aktien, Obligationen und Geldmarktinstrumente. Es werden ausschliesslich Unternehmen und Obligationenherausgeber berücksichtigt, welche den Grundsätzen der ökologischen und sozialen Nachhaltigkeit Folge leisten. Der Aktienanteil liegt dabei zwischen 40% und 60%. Mit der breiten Streuung von Aktien und Obligationen reduziert sich das Risiko im Vergleich zu einer Investition in eine Einzelanlage.

**Profil/Eignung**

- Dieser Fonds eignet sich für Anleger, die
- den Fokus auf ökologische und soziale Nachhaltigkeit setzen, dabei auf den Ertrag von Obligationen bauen und gleichzeitig von Aktienkursgewinnen profitieren möchten und eine Investition in EUR bevorzugen.
  - sowohl an Kapitalwachstum als auch an regelmässigem Einkommen interessiert sind.
  - einen langfristigen Anlagehorizont im Auge haben.
  - bereit sind, Kursschwankungen in Kauf zu nehmen.
  - ein gewisses Risiko in Kauf nehmen wollen.

Mit der Anlage sind Risiken, insbesondere diejenigen von Wert- und Ertragsschwankungen, verbunden. Weiter unterliegen Anlagen in Fremdwährungen Wechselkursschwankungen. Die Risiken sind im Einzelnen im Verkaufsprospekt dargelegt.

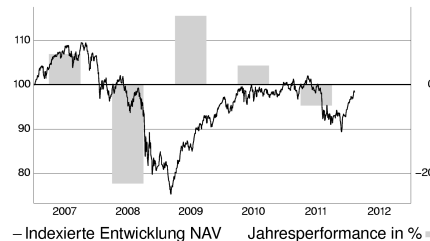

**Eckwerte**

|                                       |            |
|---------------------------------------|------------|
| Wert pro Anteil* (09.02.12)           | EUR 89.10  |
| Domizil                               | Luxemburg  |
| Abschluss Rechnungsjahr               | 31.03.     |
| Fondslancierung                       | 07.03.05   |
| Rechnungswährung                      | EUR        |
| Benchmark                             | Synthetic  |
| Volumen in Mio. (09.02.12)            | CHF 154.32 |
| Pauschale Verwaltungskommission p.a.  | 1.50%      |
| davon abgeleitete Management Fee p.a. | 1.35%      |
| Swinging Single Pricing               | Ja         |
| Ausgabeaufschlag max.                 | 5.00%      |
| TER                                   | 1.68%      |

**Kennzahlen**
**31.12.11**

|  |       |
|--|-------|
| Jensen's Alpha p.a.                    | -3.02 |
| Beta                                   | 0.98  |
| Korrelation                            | 0.89  |
| Volatilität p.a.                       | 7.74% |
| Sharpe Ratio p.a.                      | 0.45  |
| Tracking Error p.a.                    | 3.50% |
| Information Ratio p.a.                 | -0.90 |
| Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre) | 6.1   |
| Modified Duration                      | 5.19  |
| Anzahl Positionen                      | 138   |

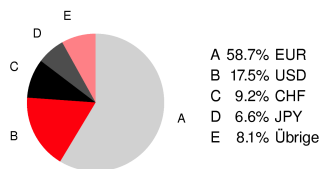
**Daten:** Lipper (letzte 3 Jahre oder seit Fondslancierung)

**Indexierte Performance in EUR**
**31.12.11**


Die vergangene Performance ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung und bietet keine Garantie für den Erfolg in der Zukunft. Die Performancedaten wurden ohne Berücksichtigung der bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten und auf der Basis der Wiedieranlage etwaiger Ausschüttungen berechnet. Die Berechnung erfolgt in der Rechnungswährung EUR. Die Rendite in anderen Währungen kann infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen.

**Quelle:** Lipper, a Thomson Reuters Company

| Performance bis | 1M    | 3M    | Lauf. Jahr | 12M    | 3J     | seit Lanc. p.a. | 2007  | 2008    | 2009   | 2010   | 2011   |
|-----------------|-------|-------|------------|--------|--------|-----------------|-------|---------|--------|--------|--------|
| 31.12.2011      |       |       |            |        |        |                 |       |         |        |        |        |
| Fonds (Tranche) | 2.81% | 3.18% | -4.68%     | -4.68% | 14.85% | n/a             | 6.89% | -22.27% | 15.51% | 4.30%  | -4.68% |
| Benchmark       | 3.44% | 5.18% | -0.13%     | -0.13% | 26.23% | n/a             | 0.42% | -17.06% | 14.78% | 10.12% | -0.13% |


**Aufteilung nach Währungen**
**30.12.11**

**Aufteilung nach Anlagekategorien**
**30.12.11**

|              | Schweiz | Europa | Nord- Amerika | Pazifik/ EmMa | Total  |
|--------------|---------|--------|---------------|---------------|--------|
| Geldmarkt    | 5.2%    | 0.0%   | 0.0%          | 0.0%          | 5.2%   |
| Obligationen | 0.0%    | 35.5%  | 2.4%          | 0.4%          | 38.3%  |
| Aktien       | 8.7%    | 21.5%  | 19.2%         | 7.1%          | 56.5%  |
| Total        | 13.9%   | 57.0%  | 21.6%         | 7.5%          | 100.0% |

**Kennzahlen**
**31.12.11**

|  |       |
|--|-------|
| Jensen's Alpha p.a.                    | -3.02 |
| Beta                                   | 0.98  |
| Korrelation                            | 0.89  |
| Volatilität p.a.                       | 7.74% |
| Sharpe Ratio p.a.                      | 0.45  |
| Tracking Error p.a.                    | 3.50% |
| Information Ratio p.a.                 | -0.90 |
| Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre) | 6.1   |
| Modified Duration                      | 5.19  |
| Anzahl Positionen                      | 138   |

**Daten:** Lipper (letzte 3 Jahre oder seit Fondslancierung)

**Grösste Aktienpositionen (5)**
**30.12.11**

|                             |       |
|-----------------------------|-------|
| PROCTER & GAMBLE CO/THE     | 2.79% |
| UNILEVER NV-CVA             | 2.35% |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 2.14% |
| VERBUND AG                  | 1.84% |
| 3M CO                       | 1.82% |

**Grösste Obligationenpositionen (5)**
**30.12.11**

|                                |       |
|--------------------------------|-------|
| AUSTRIA 6.25% 97-15.07.27      | 2.73% |
| KFW 3.5% 06-04.07.21           | 2.63% |
| GERMANY 6.5% 97-04.07.27       | 2.49% |
| NWB 3.875% 05-17.02.20         | 2.22% |
| LDBK BAD-WUERT.5.75% 02-14EMTN | 2.16% |

**Zusätzliche wichtige Hinweise:** Alle hier veröffentlichten Angaben dienen ausschliesslich Ihrer Information und stellen keine Anlageberatung oder sonstige Empfehlung dar. Wir haben den Inhalt sorgfältig recherchiert und zusammengestellt. Gleichwohl kann Swisscanto nicht die Gewähr der Richtigkeit, Vollständigkeit sowie die Aktualität der gemachten Angaben übernehmen. Alleinverbindliche Grundlage für den Erwerb von Swisscanto Anlagefonds sind die jeweiligen Verkaufsprospekte und Rechenschaftsberichte. Weitere Details zu Swinging Single Pricing finden Sie unter [www.swisscanto.ch/ssp](http://www.swisscanto.ch/ssp). \*Alle veröffentlichten Preise sind exkl. Kommissionen

**Wichtige Hinweise für Deutschland:** Verkaufsprospekt, vereinfachter Verkaufsprospekt, Vertragsbedingungen und Rechenschaftsberichte, können bei der Zahl- und Informationsstelle DekaBank, Mainzer Landstrasse 16, 60235 Frankfurt a.M. kostenlos und in Papierform bezogen werden.

**Hinweis zu TER:** Die Total Expense Ratio (TER) bezeichnet die Kommissionen, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), und wird in einem Prozentsatz des Fondsvermögens ausgedrückt. Die Angabe entspricht der Höhe der TER im zuletzt abgeschlossenen Geschäftsjahr bzw. Halbjahr und bietet keine Gewähr für eine entsprechende Höhe in der Zukunft.