

## Raiffeisen Futura II - Systematic Swiss Equity A

Der Raiffeisen Futura II - Systematic Swiss Equity bietet eine kostengünstige und effiziente Möglichkeit an der Entwicklung des Schweiz Aktienmarktes teilzunehmen. Er investiert in Schweizer Unternehmen mit dem Ziel eines langfristigen Vermögenzuwachses. Dieser indexnahe Fonds bewegt sich so nah am definierten Index wie nötig und ist dabei so nachhaltig wie möglich.

- Indexnah verwalteter Aktienfonds
- Anwendung der Raiffeisen Futura Nachhaltigkeitskriterien, um nachhaltige Titel stärker zu gewichten und nicht-nachhaltige Titel möglichst zu meiden ([www.raiffeisen.ch/nachhaltiges-anlegen](http://www.raiffeisen.ch/nachhaltiges-anlegen))
- Aktive Ausübung der Stimmrechte im Interesse der Anleger

- A-Anteilsklasse (ausschüttend), B-Anteilsklasse (thesaurierend)
- Geeignet für Anleger mit hoher Risikobereitschaft

Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, St. Gallen

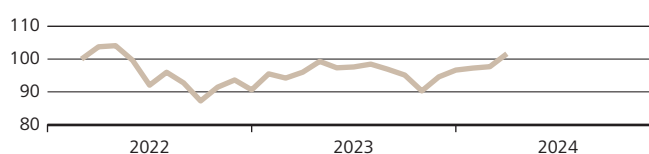
### Netto-Performance (in %)

CHF	1Mt.	2024	2023	2022	3 J. p.a.	5 J. p.a.
		01.01.-28.03.		01.03.-31.12.		
Fonds	4.04	5.15	6.66	-9.39	n.a.	n.a.
Index	3.94	5.98	6.09	-8.55	n.a.	n.a.

Vergleichsindex: Swiss Performance Index TR

### Wertentwicklung

Ausgabepreis in CHF pro Anteil (Ausschüttung reinvestiert)



Diese Angaben sind vergangenheitsbezogen. Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse. Die dargestellte Performance lässt allfällige bei Anteilszeichnung und -rücknahme erhobene Kommissionen und Kosten unberücksichtigt. Quelle für alle Daten und Grafiken (sofern nicht anders vermerkt): UBS Asset Management.

### Risikodaten

Volatilität*	9.85%
Sharpe Ratio*	0.47
(Risikoloser Zinssatz: 1.65%)	
Tracking Error*	1.05%
Jensen's Alpha*	0.12
Beta*	0.98

\* 1 Jahr annualisiert

### Grösste Sektoren



25.8%	Pharmazeutik, Kosm & med Prod
18.8%	Nahrungsmittel & Softdrinks
14.7%	Finanz & Beteiligungsgesellschaften
9.5%	Versicherungen
8.5%	Chemie
5.3%	Elektr Geräte & Komponenten
3.6%	Baugewerbe & Baumaterial
3.0%	Maschinen & Apparate
1.7%	Banken & Kreditinstitute
9.2%	Übrige

### Fondsinformationen in CHF

Fondsdomizil	Schweiz
Fondsleitung	UBS Fund Management (Switzerland) AG
Fondsmanager	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft
Management Fee p.a.	0.42%
TER (per 30.09.2023)	0.42%
Lancierungspreis	100.00
Lancierungsdatum	01.03.2022
Letzte Ausschüttung (ex)	18.07.2023
Ausschüttung	3.25
Abschluss Geschäftsjahr	31. März
Steuerwert per 31.12.2023	92.79
Valor	114 426 955
ISIN	CH1144269557

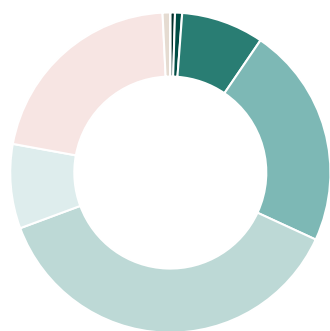
### Aktuelle Daten in CHF

Nettoinventarwert	98.21
Höchst letzte 12 Monate	100.66
Tiefst letzte 12 Monate	86.54
Fondsvermögen in Mio.	199.91

### Grösste Aktienpositionen

Nestle SA	16.3%
Novartis AG	11.9%
Roche Holding AG	10.8%
UBS Group AG	5.1%
Zurich Insurance Group AG	4.9%
ABB Ltd	4.9%
Sika AG	2.9%
Alcon Inc	2.8%
Lonza Group AG	2.7%
Swiss Re AG	2.6%

## Nachhaltigkeitsrating



Durchschnittliches Nachhaltigkeitsrating **B**

A+	0.48%	C+	21.36%
A	0.71%	C	0.00%
A-	8.34%	C-	0.00%
B+	22.34%	D+	0.00%
B	37.49%	D	0.00%
B-	8.51%	D-	0.00%
		n/a	0.77%

## Positionen mit den höchsten Nachhaltigkeitsratings

Bezeichnung	Rating	Gewicht
Temenos Group AG	A+	0.48%
SIG Group	A	0.71%
Swiss Re	A-	2.58%

## Positionen mit den tiefsten Nachhaltigkeitsratings

Bezeichnung	Rating	Gewicht
UBS	C+	5.07%
Nestlé SA	C+	16.29%
Holcim Ltd	B-	2.23%

## Treibhausgasemissionen

### Kennzahlen zu den Emissionen von Treibhausgasen (THG)

Emissionen (Total in tCO <sub>2</sub> eq)	65'921.37
- Emissionen aus den Unternehmen (Scope 1)	17'165.10
- Emissionen, die die Unternehmen einkaufen (Scope 2)	3'294.30
- Emissionen entlang der Wertschöpfungsketten (Scope 3)	45'461.96
Fussabdruck (tCO <sub>2</sub> eq/investierte Mio. CHF)	367.53
Intensität (gewicht. Durchschnitt: tCO <sub>2</sub> eq/Mio. CHF Umsatz)	1'038.93

Deckungsgrad Emissionen & Fussabdruck: 97.50%  
Deckungsgrad Intensität: 99.17%

## Kontroverse Praktiken



nicht kontrovers	32.34%
wenig kontrovers	12.95%
kontrovers	53.95%
sehr kontrovers	0.00%
n/a	0.77%

## Positionen mit den grössten THG-Intensitäten

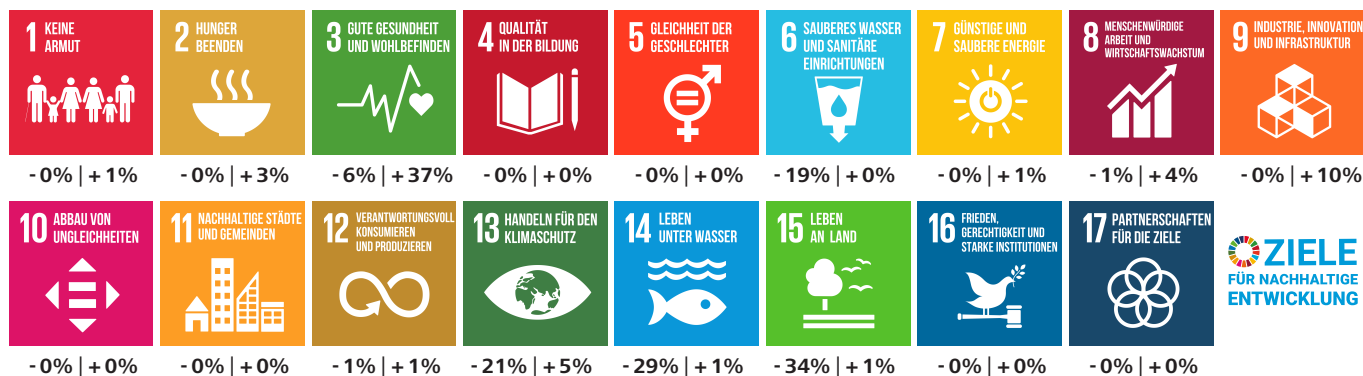
Bezeichnung	tCO <sub>2</sub> eq/Mio. CHF Umsatz	Gewicht
Holcim Ltd	5'359.89	2.23%
Emmi AG	2'096.04	0.19%
Kuehne & Nagel	1'730.87	0.82%

## Positionen mit den schwersten Kontroversen

Bezeichnung	Schweregrad	Gewicht
Nestlé SA	kontrovers	16.29%
UBS	kontrovers	5.07%
Novartis	kontrovers	11.92%

## Sustainable Development Goals (SDGs)

Die hier ausgewiesenen Werte zeigen auf, wie die Unternehmen des Fonds auf die Sustainable Development Goals einwirken. Für Unternehmen werden die verschiedenen Produkte und Dienstleistungen nach ihren positiven als auch negativen Beiträgen zu jedem der 17 Ziele bewertet und entsprechend ihrem Umsatzanteil ausgewiesen. Der Deckungsgrad beträgt 99.23%.



Dieser ESG-Report wird von yourSRI, einer FE fundinfo (Liechtenstein) Marke, betrieben.

## Nachhaltigkeitskennzahlen

### Deckungsgrad

Anteil der Anlagen für die Nachhaltigkeitskennzahlen verfügbar sind. Die Nachhaltigkeitskennzahlen beziehen sich auf Aktien, Obligationen sowie Kollektivanlagen, die in die beiden vorgenannten Anlageklassen investieren. Für Staaten werden aus methodischen Gründen keine Daten zu den Treibhausgasemissionen und den Zielen für nachhaltige Entwicklung ausgewiesen.

### Nachhaltigkeitsrating

Diese Ratings beurteilen die Leistung und die Praxis eines Unternehmens, Staats oder einer Kollektivanlage in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren (ESG). Nachhaltigkeitsratings stellen Anlegern und Anlegerinnen eine Momentaufnahme der Nachhaltigkeitsbewertung eines Unternehmens, Staats oder einer Kollektivanlage zur Verfügung. Das bestmögliche Nachhaltigkeitsrating ist A+, das schlechteste ist D-. Anlagen in Kollektivanlagen werden so bewertet und ausgewiesen, als ob diese direkt gehalten würden. Finanzinstrumente, die nicht bewertet werden können, werden mit n/a ausgewiesen.

### Treibhausgasemissionen

Angabe über die Gesamtmenge an Treibhausgasen (THG), für welche die investierten Unternehmen über den gesamten Herstellungsprozess hinaus bis hin zur Verwendung und Entsorgung der Produkte verantwortlich sind. Diese Gase umfassen insbesondere CO<sub>2</sub>, aber auch andere Gase, die entsprechend ihrer Wirksamkeit in CO<sub>2</sub>-Äquivalente (CO<sub>2</sub>eq) umgerechnet werden.

Aus dieser Angabe leiten sich zwei weitere Kennzahlen ab:

- Fussabdruck: Weist die Gesamtmenge (gemessen in Tonnen) an verursachten THG des investierten Vermögens normiert auf eine Million Schweizer Franken aus. Der Fussabdruck ist ein Mass für die Klimafreundlichkeit.
- Intensität: Ist ein Effizienzmass, das angibt, wie viel Emissionen (gemessen in Tonnen) an THG durch die investierten Unternehmen verursacht werden, um eine Million Schweizer Franken Umsatz zu generieren.

Für Staaten können aus methodischen Gründen keine Angaben gemacht werden.

### Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (Sustainable Development Goals, SDGs)

Bei den SDGs handelt es sich um 17 Zielvorgaben der Vereinten Nationen aus dem Jahr 2015, die bis 2030 umgesetzt werden und als Katalysator für eine nachhaltige Entwicklung wirken sollen. Für Unternehmen werden die verschiedenen Produkte und Dienstleistungen nach ihren positiven als auch negativen Beiträgen zu jedem der 17 Ziele bewertet und entsprechend ihrem Umsatzanteil ausgewiesen. Für Staaten können aus methodischen Gründen diesbezüglich keine Angaben gemacht werden.

### Kontroverse Praktiken

Kontroverse Praktiken sind durch Unternehmen und Staaten verursachte Ereignisse, die negative Auswirkungen auf Umwelt und Gesellschaft haben, oder Schwächen bei der Unternehmensführung aufweisen. Diese werden anhand ihres Schweregrades bewertet.

## Primärer angewandter Nachhaltigkeitsansatz

- Ausschlüsse     Best-in-Class     ESG-Integration  
 Engagement     Stimmrechtsausübung

## Nachhaltigkeitsansätze\*

### Ausschlüsse

Der Begriff Ausschlüsse bezieht sich auf den systematischen Ausschluss bestimmter Emittenten aus einem Portfolio mit der Begründung, dass ihre Geschäftstätigkeit gegen Normen oder Werte verstösst oder dass Risiken antizipiert werden.

### Best-in-Class

Die Integration von ESG-Faktoren in den Anlageprozess erfolgt durch die Auswahl von Titeln, die im Vergleich innerhalb einer Branche hinsichtlich der berücksichtigten ESG-Faktoren insgesamt positiv bewertet werden. Bei diesem Ansatz ist das Portfolio in Bezug auf Nachhaltigkeitsaspekte aufgrund bindender Kriterien (Vermeidung von schlechten Titeln im Peer-Vergleich) darauf ausgerichtet, besser als eine Vergleichsgrösse abzuschneiden.

### ESG-Integration

ESG-Integration ist die direkte Einbeziehung von ESG-Chancen bzw. -Risiken in die traditionelle Finanzanalyse und Anlageentscheidungen von Asset Managern mittels eines systematischen Prozesses und geeigneter Research-Quellen.

### Engagement

Engagement bezieht sich auf einen aktiven Dialog mit Geschäftsleitungen von Unternehmen oder anderen relevanten Stakeholdern und dem Ziel, sie davon zu überzeugen, Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien innerhalb ihres Einflussbereichs zu berücksichtigen.

### Stimmrechtsausübung

Dieser Begriff bezieht sich darauf, dass Investoren ihren Präferenzen Ausdruck verleihen, indem sie ihre Stimmrechte aktiv und auf Basis von nachhaltigkeitsbezogenen Grundsätzen oder Richtlinien ausüben. Bei Kollektivanlagen werden die Stimmrechte im Interesse der Investoren durch die Fondsleitung ausgeübt.

### Weiterführende Informationen zu den Nachhaltigkeitsansätzen

Detailliertere Informationen zu den Nachhaltigkeitsansätzen finden Sie auf: [www.raiffeisen.ch/nachhaltiges-anlegen](http://www.raiffeisen.ch/nachhaltiges-anlegen)

\* In Anlehnung an AMAS Selbstregulierung zu Transparenz und Offenlegung bei Kollektivvermögen mit Nachhaltigkeitsbezug vom 30. September 2022.

## Chancen

- Einfacher Zugang zu Aktienmärkten: Der Fonds berücksichtigt Aktien von kleinen bis grossen Unternehmen aus verschiedenen Branchen, um die Risiken gut zu verteilen.
- Diversifiziert: Der Fonds bietet Ihnen somit eine breite Diversifizierung.
- Nachhaltig: Der Fonds erfüllt die definierten Nachhaltigkeitskriterien und trägt das Raiffeisen Futura Label. Er orientiert sich an einem zugrunde liegenden Index, nutzt jedoch einen systematischen Ansatz, um nachhaltigere Titel stärker zu gewichten und nicht nachhaltige Titel möglichst zu meiden.
- Stimmrechtsausübung: Bei den Generalversammlungen der Firmen, in die der Fonds investiert ist, werden Ihre Interessen als Anleger vertreten.
- Mit oder ohne Ausschüttung: Jährliche Auszahlung der Erträge mit der A-Anteilsklasse. Die B-Anteilsklasse legt die Erträge wieder an.
- Anlegerschutz: Der Fonds ist dem Kollektivanlagengesetz unterstellt und das investierte Kapital gilt als Sondervermögen, womit Sie als Anleger hohen Schutz geniessen.
- Durchschnittspreis-Effekt: Wenn Sie via Fonds-Sparplan investieren, erwerben Sie über die Zeit Fondsanteile zum geglätteten Durchschnittspreis, unabhängig von möglichen Preisschwankungen.

## Risiken

- Wertschwankungen, Aktienkurse und Handelbarkeit: Es sind markt-, branchen- und unternehmensbedingte Kursschwankungen möglich. Aktien kleiner bis mittelgrosser Unternehmen können weniger kursstabil und weniger gut handelbar sein als Aktien grösserer Unternehmen.
- Partizipation: Die Teilhabe am Aufwärtspotenzial eines Einzeltitels ist aufgrund der Diversifikation im Fonds beschränkt.
- Derivate: Der Einsatz von Derivaten macht den Fonds von der Qualität der involvierten Gegenparteien sowie der Entwicklung der zugrundeliegenden Märkte und Basisinstrumente abhängig.
- Anteilswert: Der Fonds-Anteilswert kann unter den Kaufpreis fallen, zu dem Sie Ihren Anteil erworben haben.

## Rechtliche Hinweise

Dieses Dokument dient ausschliesslich allgemeinen Werbe- sowie Informationszwecken und ist nicht auf die individuelle Situation des Empfängers abgestimmt. Der Empfänger bleibt selbst für entsprechende Abklärungen, Prüfungen und den Beizug von Spezialisten (z.B. Steuer-, Versicherungs- oder Rechtsberater) verantwortlich. Mit «Futura» werden nachhaltige Finanzinstrumente und -dienstleistungen gekennzeichnet. Informationen zum Thema «Nachhaltiges Anlegen mit Raiffeisen» sind in der entsprechenden Broschüre ([www.raiffeisen.ch/futura-regelwerk](http://www.raiffeisen.ch/futura-regelwerk)) zu finden. Dieses Dokument stellt weder eine Anlageberatung resp. persönliche Empfehlung noch ein Angebot, eine Aufforderung oder Empfehlung zum Erwerb oder zur Veräusserung von Finanzinstrumenten dar. Erwähnte Fonds sind Fonds nach Schweizer Recht. Das Dokument stellt insbesondere keinen Prospekt und kein Basisinformationsblatt gemäss Art. 35 ff. bzw. Art. 58 ff. FIDLEG dar. Die allein massgeblichen vollständigen Bedingungen sowie die ausführlichen Risikohinweise zu den erwähnten Finanzinstrumenten sind in den jeweiligen rechtsverbindlichen Verkaufsdokumenten (z.B. Prospekt, Fondsvertrag und Basisinformationsblatt (BIB) jeweils mit den Jahres- und Halbjahresberichten) enthalten. Diese Unterlagen können kostenlos bei Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, Raiffeisenplatz, 9001 St.Gallen («Raiffeisen Schweiz») oder unter [www.raiffeisen.ch/fonds](http://www.raiffeisen.ch/fonds) sowie bei der Fondsleitung der UBS Fund Management (Switzerland) AG, Aeschenvorstadt 1, 4051 Basel und der Depotbank der UBS Switzerland AG, Zürich bezogen werden. Finanzinstrumente sollten nur nach einer persönlichen Beratung und dem Studium der rechtsverbindlichen Verkaufsdokumente sowie der Broschüre «Risiken im Handel mit Finanzinstrumenten» der Schweizerischen Bankiervereinigung (SBVg) erworben werden. Entscheide, die aufgrund dieses Dokuments getroffen werden, erfolgen im alleinigen Risiko des Empfängers. Aufgrund gesetzlicher Beschränkungen in einzelnen Staaten richten sich diese Informationen nicht an Personen mit Nationalität, Sitz oder Wohnsitz eines Staates, in welchem die Zulassung von den in diesem Dokument erwähnten Finanzinstrumente oder Finanzdienstleistungen beschränkt ist. Dieses Dokument darf weder US-Personen zur Verfügung gestellt noch an sie ausgehändigt oder in den USA verbreitet werden. Die in diesem Dokument erwähnten Fonds sind in den USA nicht zum Vertrieb zugelassen und dürfen dort weder angeboten noch verkauft oder dahin ausgeliefert werden. Bei den aufgeführten Performancedaten handelt es sich um historische Daten, aufgrund derer nicht auf die laufende oder zukünftige Entwicklung geschlossen werden kann. Für die Berechnung von Fonds-Performancedaten wurden die bei der Ausgabe und gegebenenfalls bei der Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten nicht berücksichtigt. Das vorliegende Dokument enthält zukunftsgerichtete Aussagen. Diese widerspiegeln Einschätzungen, Annahmen und Erwartungen von Raiffeisen Schweiz zum Zeitpunkt der Erstellung. Aufgrund von Risiken, Unsicherheiten und anderen Faktoren können die künftigen Ergebnisse von den zukunftsgerichteten Aussagen abweichen. Entsprechend stellen diese Aussagen keine Garantie für künftige Leistungen und Entwicklungen dar. Zu den Risiken und Unsicherheiten zählen unter anderem die im Geschäftsbericht der Raiffeisen Gruppe (verfügbar unter <https://report.raiffeisen.ch>) beschriebenen Risiken und Unsicherheiten. Dieses Dokument ist nicht das Ergebnis einer Finanzanalyse. Die «Richtlinien zur Sicherstellung der Unabhängigkeit der Finanzanalyse» der Schweizerischen Bankiervereinigung (SBVg) finden demzufolge auf dieses Dokument keine Anwendung. Raiffeisen Schweiz und die Raiffeisenbanken unternehmen alle zumutbaren Schritte, um die Zuverlässigkeit der präsentierten Daten und Inhalte zu gewährleisten. Sie übernehmen aber keine Gewähr für Aktualität, Richtigkeit und Vollständigkeit der in diesem Dokument veröffentlichten Informationen und haften nicht für allfällige Verluste oder Schäden (direkte, indirekte und Folgeschäden), die durch die Verteilung und Verwendung dieses Dokumentes oder dessen Inhalt verursacht werden. Insbesondere haften sie nicht für Verluste infolge der den Finanzmärkten inhärenten Risiken. Die in diesem Dokument geäusserten Meinungen sind diejenigen von Raiffeisen Schweiz zum Zeitpunkt der Erstellung und können sich jederzeit und ohne Mitteilung ändern. Raiffeisen Schweiz ist nicht verpflichtet, dieses Dokument zu aktualisieren. In Bezug auf allfällige, sich ergebende Steuerfolgen wird jegliche Haftung abgelehnt. Das vorliegende Dokument darf ohne schriftliche Genehmigung von Raiffeisen Schweiz weder auszugswise noch vollständig vervielfältigt und/oder weitergegeben werden.

Raiffeisen bezieht Nachhaltigkeitsinformationen, -daten, -ratings oder -materialien («Inhalte») von verschiedenen Anbietern. Dazu zählen die Inrate AG und FE fundinfo (Switzerland) AG sowie jeweils damit verbundene Unternehmen (die «ESG-Parteien»). Die Inhalte können durch die ESG-Parteien urheberrechtlich geschützt sein. Sowohl die teilweise als auch gesamthafte Reproduktion oder Vervielfältigung in jeglicher Form ist ohne vorherige schriftliche Genehmigung der betreffenden ESG-Partei untersagt. Obwohl die ESG-Parteien ihre Quellen als zuverlässig erachten, übernehmen Raiffeisen und die ESG-Parteien weder ausdrücklich noch stillschweigend eine Haftung oder Garantie für die Richtigkeit, Angemessenheit, Vollständigkeit, Aktualität oder Verfügbarkeit der Inhalte. In keinem Fall haften Raiffeisen und die ESG-Parteien für Schäden, Kosten, Ausgaben, Anwaltskosten oder Verluste (einschliesslich entgangener Einnahmen oder Gewinne und Opportunitätskosten) im Zusammenhang mit der Nutzung des Inhalts. Verweise, Ratings oder Beobachtungen auf resp. bezüglich eines bestimmten Finanzinstruments stellen weder ein Angebot noch eine Empfehlung zum Erwerb, Halten oder zur Veräusserung eines Finanzinstruments dar, beziehen sich nicht auf die Eignung eines Finanzinstruments und lassen keine verlässlichen Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu. Nachhaltigkeitsratings sind Meinungsäusserungen und keine Tatsachenaussagen.